

Analysis
— SS 2012 —
DHBW Stuttgart

Prof. Dr. Karl Stroetmann

4. Oktober 2012

Inhaltsverzeichnis

1	Einleitung	3
1.1	Überblick über die Vorlesung	3
2	Folgen und Reihen	4
2.1	Folgen	4
2.2	Berechnung der Quadrat-Wurzel	19
2.3	Reihen	22
2.4	Potenz-Reihen	32
3	Stetige und differenzierbare Funktionen	36
3.1	Stetige Funktionen	36
3.2	Bestimmung von Nullstellen	39
3.2.1	Die Regula Falsi	42
3.2.2	Das Sekanten-Verfahren	47
3.2.3	Das Illinois-Verfahren	49
3.3	Differenzierbare Funktionen	50
3.4	Mittelwert-Sätze	58
3.5	Monotonie und Konvexität	64
3.6	Die Exponential-Funktion	68
4	Anwendungen der Theorie	71
4.1	Taylor-Reihen	71
4.1.1	Beispiele von Taylor-Entwicklungen	75
4.2	Polynom-Interpolation	82
4.2.1	Interpolation nach Newton	83
4.2.2	Der Interpolations-Fehler	85
4.3	Der Banach'sche Fixpunkt-Satz	87
4.3.1	Das Newton'sche Verfahren zur Berechnung von Nullstellen	91
4.3.2	Analyse des Newton'schen Verfahrens	93
4.4	Iterative Lösung linearer Gleichungs-Systeme	97
5	Integral-Rechnung	103
5.1	Einführung des Integral-Begriffs	103
5.2	Regeln zur Berechnung von Integralen	108
5.2.1	Die Substitutions-Regel	109
5.2.2	Partielle Integration	111
5.2.3	Das Integral von Umkehr-Funktionen	111
5.2.4	Beispiele	113
5.3	Berechnung der Bogenlänge	114
5.4	Uneigentliche Integrale	115
5.5	Numerische Integration	118
5.5.1	Die Trapez-Regel	118

5.5.2	Die Simpson'sche Regel	121
6	Die Kreiszahl π und die Euler'sche Zahl e sind irrational	123
6.1	Die Euler'sche Zahl e ist irrational	123
6.2	Die Kreiszahl π ist irrational	125
6.3	Tranzendente Zahlen	128
7	Fourier-Analyse	131
7.1	Berechnung der Fourier-Koeffizienten	131
7.2	Konvergenz	135
7.3	Beispiele	135
7.3.1	Fourier-Analyse der Sägezahn-Funktion	137
8	Rundungsfehler	140

Kapitel 1

Einleitung

Der vorliegende Text ist ein Fragment eines Vorlesungs-Skriptes für die Analysis-Vorlesung für Informatiker. Ich habe mich bei der Ausarbeitung dieser Vorlesung im wesentlichen auf die folgenden Quellen gestützt:

1. Analysis I von Otto Forster [1].
2. Differential- und Integralrechnung I von Hans Grauert und Ingo Lieb [2].
3. Lehrbuch der Analysis, Teil 1 und Teil 2 von Harro Heuser [3, 4].

Den Studenten empfehle ich das erste Buch in dieser Liste, denn dieses Buch ist auch in elektronischer Form in unserer Bibliothek vorhanden.

1.1 Überblick über die Vorlesung

Im Rahmen der Vorlesung werden die folgenden Gebiete behandelt:

1. Das zweite Kapitel führt den Begriff des Grenzwerts für Folgen und Reihen ein.
2. Das dritte Kapitel diskutiert die Begriffe Stetigkeit und Differenzierbarkeit.
3. Das vierte Kapitel zeigt verschiedene Anwendungen der bis dahin dargestellten Theorie. Insbesondere werden *Taylor-Reihen* diskutiert. Diese können beispielsweise zur Berechnung der trigonometrischen Funktionen verwendet werden. Außerdem diskutieren wir in diesem Kapitel Verfahren zur numerischen Lösung von Gleichungen.
4. Das fünfte Kapitel beschäftigt sich mit der Integralrechnung.
5. Im sechsten Kapitel zeigen wir, dass π und e keine rationalen Zahlen sind.
6. Im letzten Kapitel diskutieren wir Fourier-Reihen.

Kapitel 2

Folgen und Reihen

Die Begriffe *Folgen* und *Reihen* sowie der Begriff des *Grenzwerts* bilden die Grundlage, auf der die Analysis aufgebaut ist. Da Reihen nichts anderes sind als spezielle Folgen, beginnen wir unsere Diskussion mit den Folgen.

2.1 Folgen

Definition 1 (Folge) Eine Funktion $f : \mathbb{N} \rightarrow \mathbb{R}$ bezeichnen wir als eine *reellwertige Folge*. Eine Funktion $f : \mathbb{N} \rightarrow \mathbb{C}$ bezeichnen wir als eine *komplexwertige Folge*.

Ist die Funktion f eine Folge, so schreiben wir dies kürzer als $(f(n))_{n \in \mathbb{N}}$ oder $(f_n)_{n \in \mathbb{N}}$ oder noch kürzer als $(f_n)_n$.

Beispiele:

1. Die Funktion $a : \mathbb{N} \rightarrow \mathbb{R}$, die durch $a(n) = \frac{1}{n+1}$ definiert ist, schreiben wir als die Folge $\left(\frac{1}{n+1}\right)_{n \in \mathbb{N}}$.
2. Die Funktion $a : \mathbb{N} \rightarrow \mathbb{R}$, die durch $a(n) = (-1)^n$ definiert ist, schreiben wir als die Folge $((-1)^n)_{n \in \mathbb{N}}$.
3. Die Funktion $a : \mathbb{N} \rightarrow \mathbb{R}$, die durch $a(n) = n$ definiert ist, schreiben wir als die Folge $(n)_{n \in \mathbb{N}}$.

Folgen können auch induktiv definiert werden. Um die Gleichung $x = \cos(x)$ zu lösen, können wir eine Folge $((x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ induktiv wie folgt definieren:

1. Induktions-Anfang: $x_0 := 0$.
2. Induktions-Schritt: $x_{n+1} := \cos(x_n)$.

Wir können die ersten 40 Glieder dieser Folge mit dem in Abbildung 2.1 gezeigten Programm berechnen. Wir erhalten dann die in der Tabelle 2.1 auf Seite 5 gezeigten Ergebnisse. Bei näherer Betrachtung der Ergebnisse stellen wir fest, dass die Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ in einem gewissen Sinne gegen einen festen *Grenzwert* strebt. Diese Beobachtung wollen wir in der folgenden Definition präzisieren. Vorab bezeichnen wir die Menge der positiven reellen Zahlen mit \mathbb{R}_+ , es gilt also

$$\mathbb{R}_+ = \{x \in \mathbb{R} \mid x > 0\}.$$

Definition 2 (Grenzwert) Eine Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ *konvergiert* gegen den *Grenzwert* g , falls gilt:

$$\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \exists K \in \mathbb{N} : \forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow |a_n - g| < \varepsilon.$$

```

1  solve := procedure(k) {
2      x      := []; // x[n+1] stores x_{n}
3      x[1] := 0.0;
4      for (n in [1 .. k]) {
5          x[n+1] := cos(x[n]);
6          print("x_{$n$} = $x[n+1]$");
7      }
8  };

```

Abbildung 2.1: Berechnung der durch $x_0 = 0$ und $x_{n+1} = \cos(x_n)$ definierten Folge.

n	x_n	n	x_n	n	x_n	n	x_n
0	0.000000	10	0.731404	20	0.738938	30	0.739082
1	1.000000	11	0.744237	21	0.739184	31	0.739087
2	0.540302	12	0.735605	22	0.739018	32	0.739084
3	0.857553	13	0.741425	23	0.739130	33	0.739086
4	0.654290	14	0.737507	24	0.739055	34	0.739085
5	0.793480	15	0.740147	25	0.739106	35	0.739086
6	0.701369	16	0.738369	26	0.739071	36	0.739085
7	0.763960	17	0.739567	27	0.739094	37	0.739085
8	0.722102	18	0.738760	28	0.739079	38	0.739085
9	0.750418	19	0.739304	29	0.739089	39	0.739085

Tabelle 2.1: Die ersten 40 Glieder der durch $x_0 = 0$ und $x_{n+1} = \cos(x_n)$ definierten Folge.

In diesem Fall schreiben wir

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = g.$$

Anschaulich heißt diese Definition, dass fast alle Glieder a_n der Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ einen beliebig kleinen Abstand zu dem Grenzwert g haben. Für die oben induktiv definierte Folge x_n können wir den Nachweis der Konvergenz erst in einem späteren Kapitel antreten. Wir betrachten statt dessen ein einfacheres Beispiel und beweisen, dass gilt:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n+1} = 0.$$

Beweis: Für jedes $\varepsilon > 0$ müssen wir eine Zahl K angeben, so dass für alle natürlichen Zahlen n , die größer als K sind, die Abschätzung

$$\left| \frac{1}{n+1} - 0 \right| < \varepsilon$$

gilt. Wir definieren $K := \frac{1}{\varepsilon}$. Damit ist K wohldefiniert, denn da ε positiv ist, gilt sicher auch $\varepsilon \neq 0$. Nun benutzen wir die Voraussetzung $n > K$ für $K = \frac{1}{\varepsilon}$:

$$\begin{aligned}
 n &> \frac{1}{\varepsilon} \\
 \Rightarrow n+1 &> \frac{1}{\varepsilon} & | \cdot \varepsilon \\
 \Rightarrow (n+1) \cdot \varepsilon &> 1 & | \cdot \frac{1}{n+1} \\
 \Rightarrow \varepsilon &> \frac{1}{n+1}
 \end{aligned}$$

Da andererseits $0 < \frac{1}{n+1}$ gilt, haben wir insgesamt für alle $n > K$

$$\begin{aligned} 0 &< \frac{1}{n+1} < \varepsilon \\ \Rightarrow \left| \frac{1}{n+1} \right| &< \varepsilon \\ \Rightarrow \left| \frac{1}{n+1} - 0 \right| &< \varepsilon \end{aligned}$$

gezeigt und damit ist der Beweis abgeschlossen. \square

Aufgabe 1: Beweisen Sie $\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{2^n} = 0$.

Wir formulieren und beweisen einige unmittelbare Folgerungen aus der obigen Definition des Grenzwerts.

Satz 3 (Eindeutigkeit des Grenzwerts) Konvergiert die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ sowohl gegen den Grenzwert g_1 als auch gegen den Grenzwert g_2 , so gilt $g_1 = g_2$.

Beweis: Wir führen den Beweis indirekt und nehmen an, dass $g_1 \neq g_2$ ist. Dann definieren wir $\varepsilon = \frac{1}{2} \cdot |g_2 - g_1|$ und aus der Annahme $g_1 \neq g_2$ folgt $\varepsilon > 0$. Aus der Voraussetzung, dass $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegen g_1 konvergiert folgt, dass es ein K_1 gibt, so dass gilt:

$$\forall n \in \mathbb{N} : n > K_1 \rightarrow |a_n - g_1| < \varepsilon$$

Analog folgt aus der Voraussetzung, dass $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegen g_2 konvergiert, dass es ein K_2 gibt, so dass gilt:

$$\forall n \in \mathbb{N} : n > K_2 \rightarrow |a_n - g_2| < \varepsilon$$

Wir setzen $K := \max(K_1, K_2)$. Alle $n \in \mathbb{N}$, die größer als K sind, sind dann sowohl größer als K_1 als auch größer als K_2 . Unter Benutzung der *Dreiecksungleichung*¹ erhalten wir für alle $n > K$ die folgende Kette von Ungleichungen:

$$\begin{aligned} 2 \cdot \varepsilon &= |g_2 - g_1| \\ &= |(g_2 - a_n) + (a_n - g_1)| \\ &\leq |g_2 - a_n| + |a_n - g_1| \quad (\text{Dreiecksungleichung}) \\ &< \varepsilon + \varepsilon \\ &= 2 \cdot \varepsilon \end{aligned}$$

Aus dieser Ungleichungs-Kette würde aber $2 \cdot \varepsilon < 2 \cdot \varepsilon$ folgen und dass ist ein Widerspruch. Somit ist die Annahme $g_1 \neq g_2$ falsch und es muss $g_1 = g_2$ gelten. \square

Bemerkung: Die Schreibweise $\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = g$ wird durch den letzten Satz im Nachhinein gerechtfertigt.

Aufgabe 2: Zeigen Sie, dass die Folge $((-1)^n)_{n \in \mathbb{N}}$ nicht konvergent ist.

Lösung: Wir führen den Beweis indirekt und nehmen an, dass die Folge $((-1)^n)_{n \in \mathbb{N}}$ konvergiert. Bezeichnen wir diesen Grenzwert mit s , so gilt also

$$\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \exists K \in \mathbb{R} : \forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow |(-1)^n - s| < \varepsilon$$

Daher gibt es für $\varepsilon = 1$ eine Zahl K , so dass

$$\forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow |(-1)^n - s| < 1$$

¹ Sind $a, b \in \mathbb{R}$, so gilt $|a + b| \leq |a| + |b|$. Diese Ungleichung trägt den Namen *Dreiecksungleichung*.

gilt. Da aus $n > K$ sicher auch $2 \cdot n > K$ und $2 \cdot n + 1 > K$ folgt, hätten wir dann für $n > K$ die beiden folgenden Ungleichungen:

$$|(-1)^{2 \cdot n} - s| < 1 \quad \text{und} \quad |(-1)^{2 \cdot n + 1} - s| < 1$$

Wegen $(-1)^{2 \cdot n} = 1$ und $(-1)^{2 \cdot n + 1} = -1$ haben wir also

$$|1 - s| < 1 \quad \text{und} \quad |-1 - s| < 1. \quad (2.1)$$

Wegen $-1 - s = (-1) \cdot (1 + s)$ und $|a \cdot b| = |a| \cdot |b|$ können wir die letzte Ungleichung noch vereinfachen zu

$$|1 + s| < 1. \quad (2.2)$$

Aus den beiden Ungleichungen $|1 - s| < 1$ und $|1 + s| < 1$ erhalten wir nun einen Widerspruch:

$$\begin{aligned} 2 &= |1 + 1| \\ &= |(1 - s) + (s + 1)| \\ &\leq |1 - s| + |1 + s| && \text{(Dreiecksungleichung)} \\ &< 1 + 1 && \text{wegen der Ungleichungen (2.1) und (2.2)} \\ &= 2 \end{aligned}$$

Fassen wir diese Ungleichungs-Kette zusammen, so haben die (offensichtlich falsche) Ungleichung $2 < 2$ abgeleitet. Damit haben wir aus der Annahme, dass die Folge gegen den Grenzwert s konvergiert, einen Widerspruch hergeleitet. \square

Definition 4 (beschränkte Folgen) Eine Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist *beschränkt*, falls es eine *Schranke* S gibt, so dass gilt:

$$\forall n \in \mathbb{N} : |a_n| \leq S.$$

Die Folge $((-1)^n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist durch die Schranke $S = 1$ beschränkt, denn offenbar gilt

$$|(-1)^n| = 1 \leq 1,$$

aber die Folge $(n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist nicht beschränkt, denn sonst gäbe es eine Zahl S , so dass für alle natürlichen Zahlen n die Ungleichung $n \leq S$ gilt. Da es beliebig große natürliche Zahlen gibt, kann dies nicht sein.

Satz 5 (Beschränktheit konvergenter Folgen) Jede konvergente Folge ist beschränkt.

Beweis: Es sei $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine konvergente Folge und es gelte

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = g.$$

Dann gibt es für beliebige $\varepsilon > 0$ ein K , so dass gilt

$$\forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow |a_n - g| < \varepsilon.$$

Wir können also für $\varepsilon = 1$ ein K finden, so dass

$$\forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow |a_n - g| < 1$$

gilt. Wir können ohne Einschränkung der Allgemeinheit davon ausgehen, dass K eine natürliche Zahl ist, denn wenn K keine natürliche Zahl ist, können wir K einfach durch die erste natürliche Zahl ersetzen, die größer als K ist. Dann definieren wir

$$S := \max\{|a_0|, |a_1|, \dots, |a_K|, 1 + |g|\}.$$

Wir behaupten, dass S eine Schranke für die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist, wir zeigen also, dass für alle $n \in \mathbb{N}$ gilt:

$$|a_n| \leq S$$

Um diese Ungleichung nachzuweisen, führen wir eine Fall-Unterscheidung durch:

1. Fall: $n \leq K$. Dann gilt offenbar

$$|a_n| \in \{|a_0|, |a_1|, \dots, |a_K|, 1 + |g|\}.$$

und daraus folgt sofort

$$|a_n| \leq \max\{|a_0|, |a_1|, \dots, |a_K|, 1 + |g|\} = S.$$

2. Fall: $n > K$. Dann haben wir

$$\begin{aligned} |a_n| &= |a_n - g + g| \\ &\leq |a_n - g| + |g| \quad (\text{Dreiecksungleichung}) \\ &< 1 + |g| \quad \text{wegen } n > K \\ &\leq S \end{aligned} \quad \square$$

Aus den letzten beiden Sätzen folgt nun sofort, dass die Folge $(n)_{n \in \mathbb{N}}$ nicht konvergiert, denn diese Folge ist noch nicht einmal beschränkt.

Satz 6 (Summe konvergenter Folgen) Sind $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ zwei Folgen, so dass

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = a \quad \wedge \quad \lim_{n \rightarrow \infty} b_n = b$$

gilt, dann konvergiert die Folge $(a_n + b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegen den Grenzwert $a + b$, in Zeichen:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} (a_n + b_n) = \left(\lim_{n \rightarrow \infty} a_n \right) + \left(\lim_{n \rightarrow \infty} b_n \right).$$

Beweis: Es sei $\varepsilon > 0$ fest vorgegeben. Wir suchen ein K , so dass

$$\forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow |(a_n + b_n) - (a + b)| < \varepsilon$$

gilt. Nach Voraussetzung gibt es für beliebige $\varepsilon' > 0$ ein K_1 und ein K_2 , so dass

$$\forall n \in \mathbb{N} : n > K_1 \rightarrow |a_n - a| < \varepsilon' \quad \text{und} \quad \forall n \in \mathbb{N} : n > K_2 \rightarrow |b_n - b| < \varepsilon'$$

gilt. Wir setzen nun $\varepsilon' := \frac{1}{2} \cdot \varepsilon$. Dann gibt es also K_1 und K_2 , so dass

$$\forall n \in \mathbb{N} : n > K_1 \rightarrow |a_n - a| < \frac{1}{2} \cdot \varepsilon \quad \text{und} \quad \forall n \in \mathbb{N} : n > K_2 \rightarrow |b_n - b| < \frac{1}{2} \cdot \varepsilon$$

gilt. Wir definieren $K := \max(K_1, K_2)$. Damit gilt dann für alle $n > K$:

$$\begin{aligned} |(a_n + b_n) - (a + b)| &= |(a_n + b_n) - (a + b)| \\ &= |(a_n - a) + (b_n - b)| \\ &\leq |a_n - a| + |b_n - b| \quad (\text{Dreiecksungleichung}) \\ &< \frac{1}{2} \cdot \varepsilon + \frac{1}{2} \cdot \varepsilon \\ &= \varepsilon. \end{aligned}$$

Damit ist die Behauptung gezeigt. \square

Aufgabe 3: Zeigen Sie: Sind $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ zwei Folgen, so dass

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = a \quad \wedge \quad \lim_{n \rightarrow \infty} b_n = b$$

gilt, dann konvergiert die Folge $(a_n - b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegen den Grenzwert $a - b$, in Zeichen:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} (a_n - b_n) = \left(\lim_{n \rightarrow \infty} a_n \right) - \left(\lim_{n \rightarrow \infty} b_n \right).$$

Satz 7 (Produkt konvergenter Folgen) Sind $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ zwei Folgen, so dass

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = a \quad \wedge \quad \lim_{n \rightarrow \infty} b_n = b$$

gilt, dann konvergiert die Folge $(a_n \cdot b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegen den Grenzwert $a \cdot b$, in Zeichen:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} (a_n \cdot b_n) = \left(\lim_{n \rightarrow \infty} a_n \right) \cdot \left(\lim_{n \rightarrow \infty} b_n \right).$$

Beweis: Es sei $\varepsilon > 0$ fest vorgegeben. Wir suchen ein K , so dass

$$\forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow |(a_n \cdot b_n) - (a \cdot b)| < \varepsilon$$

gilt. Da die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ konvergent ist, ist diese Folge auch beschränkt, es gibt also eine Zahl S , so dass

$$|a_n| \leq S \quad \text{für alle } n \in \mathbb{N}$$

gilt. Nach Voraussetzung gibt es für beliebige $\varepsilon_1 > 0$ ein K_1 und für beliebige $\varepsilon_2 > 0$ ein K_2 , so dass

$$\forall n \in \mathbb{N} : n > K_1 \rightarrow |a_n - a| < \varepsilon_1 \quad \text{und} \quad \forall n \in \mathbb{N} : n > K_2 \rightarrow |b_n - b| < \varepsilon_2$$

gilt. Wir setzen nun $\varepsilon_1 := \frac{\varepsilon}{2 \cdot (|b| + 1)}$ und $\varepsilon_2 := \frac{\varepsilon}{2 \cdot S}$. Dann gibt es also K_1 und K_2 , so dass

$$\forall n \in \mathbb{N} : n > K_1 \rightarrow |a_n - a| < \frac{\varepsilon}{2 \cdot (|b| + 1)} \quad \text{und} \quad \forall n \in \mathbb{N} : n > K_2 \rightarrow |b_n - b| < \frac{\varepsilon}{2 \cdot S}$$

gilt. Wir definieren $K := \max(K_1, K_2)$. Damit gilt dann für alle $n > K$:

$$\begin{aligned} |a_n \cdot b_n - a \cdot b| &= |(a_n \cdot b_n - a_n \cdot b) + (a_n \cdot b - a \cdot b)| \\ &\leq |(a_n \cdot b_n - a_n \cdot b)| + |(a_n \cdot b - a \cdot b)| \quad (\text{Dreiecksungleichung}) \\ &= |a_n| \cdot |b_n - b| + |a_n - a| \cdot |b| \\ &\leq S \cdot |b_n - b| + |a_n - a| \cdot (|b| + 1) \\ &< S \cdot \frac{\varepsilon}{2 \cdot S} + \frac{\varepsilon}{2 \cdot (|b| + 1)} \cdot (|b| + 1) \\ &\leq \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon}{2} \\ &= \varepsilon. \end{aligned}$$

Damit ist die Behauptung gezeigt. □

Aufgabe 4: Zeigen Sie: Sind $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ zwei Folgen, so dass

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = a \quad \wedge \quad \lim_{n \rightarrow \infty} b_n = b$$

gilt und gilt $b_n \neq 0$ für alle $n \in \mathbb{N}$, sowie $b \neq 0$, so konvergiert die Folge $(a_n/b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegen den Grenzwert a/b , in Zeichen:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{a_n}{b_n} = \frac{\left(\lim_{n \rightarrow \infty} a_n \right)}{\left(\lim_{n \rightarrow \infty} b_n \right)} = \frac{a}{b}.$$

Lösung: Zunächst können wir das Problem vereinfachen, wenn wir die Folge $(a_n/b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ als Folge von Produkten schreiben:

$$\left(\frac{a_n}{b_n} \right)_{n \in \mathbb{N}} = (a_n)_{n \in \mathbb{N}} \cdot \left(\frac{1}{b_n} \right)_{n \in \mathbb{N}}$$

Falls wir zeigen können, dass

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{b_n} = \frac{1}{b}$$

gilt, dann folgt die Behauptung aus dem Satz über das Produkt konvergenter Folgen. Bei unserer Suche nach einem Beweis starten wir damit, dass wir die Behauptung noch einmal hinschreiben:

$$\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \exists K \in \mathbb{R} : \forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow \left| \frac{1}{b_n} - \frac{1}{b} \right| < \varepsilon \quad (2.3)$$

Wir müssen also für alle $\varepsilon > 0$ ein K finden, so dass für alle natürlichen Zahlen $n > K$ die Ungleichung

$$\left| \frac{1}{b_n} - \frac{1}{b} \right| < \varepsilon \quad (2.4)$$

gilt. Irgendwie müssen wir die Voraussetzung, dass die Folge $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegen b konvergiert, ausnutzen. Diese Voraussetzung lautet ausgeschrieben

$$\forall \varepsilon' \in \mathbb{R}_+ : \exists K' \in \mathbb{R} : \forall n \in \mathbb{N} : n > K' \rightarrow |b_n - b| < \varepsilon' \quad (2.5)$$

Wir zeigen zunächst eine Abschätzung für die Beträge $|b_n|$, die wir später brauchen. Hier hilft uns die Voraussetzung, dass $b \neq 0$ ist. Setzen wir in Ungleichung (2.5) für ε' den Wert $\frac{1}{2} \cdot |b|$ ein, so erhalten wir eine Zahl K_1 , so dass für alle natürlichen Zahlen $n > K_1$

$$|b_n - b| < \frac{1}{2} \cdot |b|$$

gilt. Damit folgt:

$$\begin{aligned} |b| &= |b - b_n + b_n| \\ \Rightarrow |b| &\leq |b - b_n| + |b_n| \\ \Rightarrow |b| &< \frac{1}{2} \cdot |b| + |b_n| \\ \Rightarrow \frac{1}{2} \cdot |b| &< |b_n| \\ \Rightarrow \frac{2}{|b|} &> \frac{1}{|b_n|} \end{aligned}$$

Damit wissen wir also, dass für alle $n > K_1$ die Ungleichung

$$\frac{1}{2} \cdot |b| < |b_n|$$

gilt. Um nun für ein gegebenes $\varepsilon > 0$ die Ungleichung (2.4) zu zeigen, setzen wir in der Voraussetzung (2.5) $\varepsilon' = \frac{1}{2} \cdot |b|^2 \cdot \varepsilon$ und erhalten ein K_2 , so dass für alle $n > K_2$ die Ungleichung

$$|b - b_n| < \frac{1}{2} \cdot |b|^2 \cdot \varepsilon \quad (2.6)$$

gilt. Setzen wir $K := \max(K_1, K_2)$, so erhalten wir für alle $n > k$ die folgende Ungleichungs-Kette:

$$\begin{aligned}
 \left| \frac{1}{b_n} - \frac{1}{b} \right| &= \left| \frac{b - b_n}{b \cdot b_n} \right| \\
 &= \frac{1}{|b| \cdot |b_n|} \cdot |b - b_n| \\
 &\leq \frac{2}{|b| \cdot |b|} \cdot |b - b_n| \quad \text{wegen } \frac{2}{|b|} > \frac{1}{|b_n|} \\
 &< \frac{2}{|b| \cdot |b|} \cdot \frac{1}{2} \cdot |b|^2 \cdot \varepsilon \quad \text{wegen (2.6)} \\
 &= \varepsilon
 \end{aligned}$$

Damit haben wir für $n > K$ die Ungleichung $\left| \frac{1}{b_n} - \frac{1}{b} \right| < \varepsilon$ hergeleitet und der Beweis ist abgeschlossen. \square

Die bisher bewiesenen Sätzen können wir benutzen um die Grenzwerte von Folgen zu berechnen. Wir geben ein Beispiel:

$$\begin{aligned}
 \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{n}{n+1} &= \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{1 + \frac{1}{n}} \\
 &= \frac{\lim_{n \rightarrow \infty} 1}{\lim_{n \rightarrow \infty} 1 + \frac{1}{n}} \\
 &= \frac{1}{\lim_{n \rightarrow \infty} 1 + \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n}} \\
 &= \frac{1}{1 + 0} \\
 &= 1
 \end{aligned}$$

Hier ist der Ausdruck $\frac{1}{n}$ für $n = 0$ zwar undefiniert, aber bei der Betrachtung des Grenzwertes für $n \rightarrow \infty$ spielen die Anfangswerte der Folge offenbar keine Rolle.

Satz 8 Sind $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ zwei konvergente Folgen, so dass

$$\forall n \in \mathbb{N} : a_n \leq b_n$$

gilt, dann gilt auch

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n \leq \lim_{n \rightarrow \infty} b_n.$$

Aufgabe 5: Beweisen Sie den letzten Satz.

Definition 9 (Dedekindscher Schnitt)

Ein Paar $\langle M_1, M_2 \rangle$ heißt *Dedekindscher Schnitt* (Richard Dedekind, 1831-1916) falls folgendes gilt:

1. $M_1 \subseteq \mathbb{R}, \quad M_2 \subseteq \mathbb{R}.$
2. $M_1 \neq \emptyset, \quad M_2 \neq \emptyset.$

$$3. \forall x_1 \in M_1 : \forall x_2 \in M_2 : x_1 < x_2.$$

$$4. M_1 \cup M_2 = \mathbb{R}.$$

Beispiel: Definieren wir

$$M_1 := \{x \in \mathbb{R} \mid x \leq 0 \vee x^2 \leq 2\} \quad \text{und} \quad M_2 := \{x \in \mathbb{R} \mid x > 0 \wedge x^2 > 2\},$$

so enthält M_1 alle die Zahlen, die kleiner oder gleich $\sqrt{2}$ sind, während M_2 alle Zahlen enthält, die größer als $\sqrt{2}$ sind. Das Paar $\langle M_1, M_2 \rangle$ ist dann ein Dedekindscher Schnitt.

Axiom 10 (Vollständigkeit der reellen Zahlen) Ist $\langle M_1, M_2 \rangle$ ein Dedekind'scher Schnitt, so gibt es eine *Trennungszahl* $s \in \mathbb{R}$, so dass gilt:

$$\forall x_1 \in M_1 : x_1 \leq s \quad \text{und} \quad \forall x_2 \in M_2 : s \leq x_2.$$

Das Axiom der Vollständigkeit kann anschaulich als die Aussage interpretiert werden, dass die Menge der reellen Zahlen keine Löcher hat. Es geht auf Richard Dedekind [5] zurück.

Definition 11 (monoton) Eine Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist *monoton steigend* falls

$$\forall n \in \mathbb{N} : a_n \leq a_{n+1}$$

gilt. Analog heißt eine Folge *monoton fallend* falls

$$\forall n \in \mathbb{N} : a_n \geq a_{n+1}.$$

Ein Beispiel für eine monoton fallende Folge ist die Folge $\left(\frac{1}{n}\right)_{n \in \mathbb{N}}$, denn es gilt

$$\begin{aligned} n+1 &\geq n & | \cdot \frac{1}{n} \\ \Rightarrow \frac{n+1}{n} &\geq 1 & | \cdot \frac{1}{n+1} \\ \Rightarrow \frac{1}{n} &\geq \frac{1}{n+1} \end{aligned}$$

Satz 12 Ist die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ monoton fallend und beschränkt, so ist die Folge auch konvergent.

Beweis: Wir definieren einen Dedekind'schen Schnitt $\langle M_1, M_2 \rangle$ wie folgt:

1. M_1 definieren wir als die Menge aller unteren Schranken der Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$

$$M_1 := \{x \in \mathbb{R} \mid \forall n \in \mathbb{N} : x \leq a_n\}.$$

Weil wir vorausgesetzt haben, dass die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ beschränkt ist, ist die Menge M_1 sicher nicht leer.

2. M_2 definieren wir als das Komplement der Menge M_1 in \mathbb{R} :

$$\begin{aligned} M_2 &= \mathbb{R} \setminus M_1 \\ &= \mathbb{R} \setminus \{x \in \mathbb{R} \mid \forall n \in \mathbb{N} : x \leq a_n\} \\ &= \{x \in \mathbb{R} \mid \neg \forall n \in \mathbb{N} : x \leq a_n\} \\ &= \{x \in \mathbb{R} \mid \exists n \in \mathbb{N} : \neg x \leq a_n\} \\ &= \{x \in \mathbb{R} \mid \exists n \in \mathbb{N} : a_n < x\} \end{aligned}$$

Aus dieser Definition folgt unmittelbar, dass $M_1 \cup M_2 = \mathbb{R}$ ist. Wir wissen schon, dass $M_1 \neq \emptyset$, aber es gilt auch $M_2 \neq \emptyset$, denn offenbar liegt die Zahl $a_0 + 1$ in der Menge M_2 .

Um zu zeigen, dass das Paar $\langle M_1, M_2 \rangle$ ein Dedekind'scher Schnitt ist, müssen wir noch

$$\forall x_1 \in M_1 : \forall x_2 \in M_2 : x_1 < x_2$$

zeigen. Sei also $x_1 \in M_1$ und $x_2 \in M_2$. Nach Definition von M_2 gibt es dann eine natürliche Zahl n , für die $a_n < x_2$ ist. Nach Definition von M_1 gilt für alle natürlichen Zahlen m die Ungleichung $x_1 \leq a_m$. Insbesondere gilt die Ungleichung dann auch für die natürliche Zahl n , wir haben also

$$x_1 \leq a_n < x_2 \quad \text{und damit} \quad x_1 < x_2.$$

Folglich ist $\langle M_1, M_2 \rangle$ ein Dedekind'scher Schnitt und es gibt eine Trennungs-Zahl s mit der Eigenschaft, dass

$$\forall x_1 \in M_1 : x_1 \leq s \quad \text{und} \quad \forall x_2 \in M_2 : s \leq x_2$$

gilt. Wir zeigen, dass diese Zahl s der gesuchte Grenzwert der Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist, wir zeigen also, dass

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = s$$

gilt. Dazu beweisen wir zunächst, dass $s \in M_1$ ist. Wir führen diesen Nachweis indirekt und nehmen an, dass $s \in M_2$ ist. Dann gibt es ein $n \in \mathbb{N}$, so dass

$$a_n < s$$

ist. Der arithmetische Mittelwert von a_n und s liegt zwischen a_n und s , es gilt also

$$a_n < \frac{1}{2} \cdot (a_n + s) < s.$$

Nach Definition der Trennungs-Zahl s folgt aus $\frac{1}{2} \cdot (a_n + s) < s$, dass

$$\frac{1}{2} \cdot (a_n + s) \in M_1$$

ist. Nach Definition von M_1 gilt dann

$$\begin{aligned} \frac{1}{2} \cdot (a_n + s) &\leq a_n \\ \Rightarrow a_n + s &\leq 2 \cdot a_n \\ \Rightarrow s &\leq a_n. \end{aligned}$$

Das steht im Widerspruch zu $a_n < s$ und widerlegt die Annahme $s \in M_2$. Folglich gilt $s \in M_1$ und nach Definition von M_1 haben wir damit für alle $n \in \mathbb{N}$

$$s \leq a_n.$$

Sei nun ein $\varepsilon > 0$ vorgegeben. Wir betrachten die Zahl $s + \varepsilon$. Wegen $s < s + \varepsilon$ muss diese Zahl ein Element der Menge M_2 sein. Nach Definition von M_2 gibt es ein $n_0 \in \mathbb{N}$, so dass

$$a_{n_0} < s + \varepsilon$$

gilt. Aufgrund der Monotonie folgt dann aber für alle $n \geq n_0$

$$a_n \leq a_{n_0} < s + \varepsilon.$$

Insgesamt haben wir

$$s \leq a_n \leq a_{n_0} < s + \varepsilon$$

und daraus folgt

$$|a_n - s| < \varepsilon$$

für alle $n > n_0$ und damit ist bewiesen, dass $\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = s$ gilt. \square

Aufgabe 6: Die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ sei monoton steigend und beschränkt. Zeigen Sie, dass der Grenzwert $\lim_{n \rightarrow \infty} a_n$

existiert.

Aufgabe 7: Es seien $a, b \in \mathbb{R}$ und es gelte $a < b$. Zeigen Sie, dass dann auch

$$a < \frac{1}{2} \cdot (a + b) \quad \text{und} \quad \frac{1}{2} \cdot (a + b) < b$$

gilt.

Definition 13 (Infimum, Supremum) Eine Teilmenge M der reellen Zahlen ist nach *oben* (bzw. *nach unten*) *beschränkt*, falls es eine Schranke $o \in \mathbb{R}$ (bzw. $u \in \mathbb{R}$) gibt, so dass gilt:

$$\forall x \in M : x \leq o \quad (\text{bzw. } \forall x \in M : x \geq u).$$

Eine Zahl s ist das *Supremum* einer Menge M , wenn s die kleinste obere Schranke von M ist, es muss also gelten:

$$\forall x \in M : x \leq s \quad \text{und} \quad \forall t \in \mathbb{R} : \left((\forall x \in M : x \leq t) \rightarrow s \leq t \right)$$

In diesem Fall schreiben wir

$$s = \sup(M).$$

Analog ist eine Zahl s das *Infimum* einer Menge M , wenn s die größte untere Schranke von M ist, es muss also gelten:

$$\forall x \in M : s \leq x \quad \text{und} \quad \forall t \in \mathbb{R} : \left((\forall x \in M : t \leq x) \rightarrow t \leq s \right)$$

In diesem Fall schreiben wir

$$s = \inf(M).$$

Aufgabe 8: Zeigen Sie unter Verwendung des Vollständigkeits-Axioms: Jede nichtleere nach unten beschränkte Menge M besitzt ein Infimum.

Lösung: Wir konstruieren das Infimum als Trennungs-Zahl eines Dedekind'schen Schnitts. Wir definieren den Dedekind'schen Schnitt $\langle M_1, M_2 \rangle$ wie folgt:

1. $M_1 := \{u \in \mathbb{R} \mid \forall x \in M : u \leq x\}.$

M_1 ist also die Menge der unteren Schranken von M . Da wir vorausgesetzt hatten, dass M nach unten beschränkt ist, ist klar dass $M_1 \neq \emptyset$ gilt.

2. Damit $\langle M_1, M_2 \rangle$ ein Dedekind'scher Schnitt wird, muss M_2 das Komplement von M_1 in der Menge \mathbb{R} sein:

$$\begin{aligned} M_2 &:= \mathbb{R} \setminus M_1 \\ &= \mathbb{R} \setminus \{u \in \mathbb{R} \mid \forall x \in M : u \leq x\} \\ &= \mathbb{R} \setminus \{v \in \mathbb{R} \mid \forall x \in M : v \leq x\} \\ &= \{v \in \mathbb{R} \mid \neg (\forall x \in M : v \leq x)\} \\ &= \{v \in \mathbb{R} \mid \exists x \in M : \neg(v \leq x)\} \\ &= \{v \in \mathbb{R} \mid \exists x \in M : x < v\} \end{aligned}$$

M_2 ist also die Menge der Zahlen, die keine unteren Schranken von M sind. Da die Menge M nicht leer ist, gibt es ein $x \in M$. Wegen $x < x + 1$ ist $x + 1$ keine untere Schranke von M , also gilt $x + 1 \in M_2$ und damit gilt $M_2 \neq \emptyset$.

Um nachzuweisen, dass $\langle M_1, M_2 \rangle$ ein Dedekind'scher Schnitt ist, müssen wir nur noch zeigen, dass für alle $u \in M_1$ und alle $v \in M_2$ die Ungleichung $u < v$ gilt. Seien also $u \in M_1$ und $v \in M_2$ gegeben. Aus der Definition von M_2 folgt dann, dass es eine Zahl $x \in M$ gibt, so dass

$$x < v$$

gilt. Da M_1 die Menge der unteren Schranken von M ist, folgt aus $x \in M$ sofort

$$u \leq x.$$

Aus den letzten beiden Ungleichungen folgt nun

$$u \leq x < v \quad \text{also} \quad u < v.$$

Also ist $\langle M_1, M_2 \rangle$ ein Dedekind'scher Schnitt und nach dem Vollständigkeits-Axioms gibt es eine Trennungs-Zahl s . Wir behaupten, dass s das Infimum der Menge M ist. Dazu müssen wir zwei Dinge zeigen:

1. s ist eine untere Schranke von M .

Wir nehmen an, dass $s \in M_2$ ist. Nach Definition von M_2 gibt es dann eine Zahl $z \in M$, so dass

$$z < s$$

gilt. Wir betrachten den arithmetischen Mittelwert von s und z , der natürlich zwischen diesen beiden Zahlen liegen muss:

$$z < \frac{1}{2} \cdot (z + s) < s.$$

Da s die Trennungs-Zahl des Dedekind'schen Schnitts $\langle M_1, M_2 \rangle$ ist, folgt aus $\frac{1}{2} \cdot (z + s) < s$ sofort $\frac{1}{2} \cdot (z + s) \in M_1$. Da M_1 aber die Menge der unteren Schranken der Menge M ist, und $z \in M$ ist, folgt

$$\frac{1}{2} \cdot (z + s) \leq z.$$

Das steht im Widerspruch zu der Ungleichung $z < \frac{1}{2} \cdot (z + s)$ und zeigt, dass die Annahme $s \in M_2$ falsch ist. Also muss $s \in M_1$ sein. Da M_1 die Menge der unteren Schranken der Menge M ist, ist auch s eine untere Schranke der Menge M :

$$\forall x \in M : s \leq x.$$

2. s ist die größte untere Schranke von M .

Für die Trennungs-Zahl s des Dedekind'schen Schnitts $\langle M_1, M_2 \rangle$ gilt:

$$\forall u \in M_1 : u \leq s.$$

Setzen wir hier die Definition von M_1 ein, so erhalten wir:

$$\begin{aligned} & \forall u \in M_1 : u \leq s \\ \Rightarrow & \forall u \in \mathbb{R} : u \in M_1 \rightarrow u \leq s \\ \Rightarrow & \forall u \in \mathbb{R} : u \in \{u \in \mathbb{R} \mid \forall x \in M : u \leq x\} \rightarrow u \leq s \\ \Rightarrow & \forall u \in \mathbb{R} : (\forall x \in M : u \leq x) \rightarrow u \leq s \end{aligned}$$

Diese Formel drückt aus, dass alle unteren Schranken der Menge M unterhalb von s liegen. Da wir oben schon gezeigt haben, dass s eine untere Schranke von M ist, folgt also, dass s die größte untere Schranke ist. \square

Die Begriffe *Supremum* und *Infimum* sind Verallgemeinerungen der Begriffe Minimum und Maximum. Betrachten wir die Menge

$$M = \left\{ \frac{1}{n} \mid n \in \mathbb{N} \wedge n > 0 \right\}.$$

Diese Menge hat kein Minimum, aber 0 ist die größte untere Schranke dieser Menge, es gilt also

$$0 = \inf \left\{ \frac{1}{n} \mid n \in \mathbb{N} \wedge n > 0 \right\}.$$

Definition 14 (Cauchy-Folge)

Eine Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ heißt *Cauchy-Folge* (Augustin-Louis Cauchy, 1789-1857), falls gilt:

$$\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \exists K \in \mathbb{N} : \forall m, n \in \mathbb{N} : m \geq K \wedge n \geq K \rightarrow |a_m - a_n| < \varepsilon.$$

In einer Cauchy-Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ liegen also die einzelnen Folgenglieder a_n mit wachsendem n immer dichter zusammen. Wir werden sehen, dass eine Folge genau dann konvergent ist, wenn die Folge eine Cauchy-Folge ist.

Satz 15 Jede konvergente Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist eine Cauchy-Folge.

Beweis: Es sei $a := \lim_{n \rightarrow \infty} a_n$. Sei $\varepsilon > 0$ gegeben. Aufgrund der Konvergenz der Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gibt es dann ein K , so dass

$$\forall n \in \mathbb{N} : n \geq K \rightarrow |a_n - a| < \frac{\varepsilon}{2}$$

gilt. Damit gilt für alle $m, n \in \mathbb{N}$ mit $m \geq K$ und $n \geq K$ die folgende Abschätzung:

$$\begin{aligned} |a_m - a_n| &= |(a_m - a) + (a - a_n)| \\ &\leq |a_m - a| + |a - a_n| \\ &< \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon}{2} \\ &= \varepsilon \end{aligned}$$

Damit ist gezeigt, dass $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Cauchy-Folge ist. \square

Satz 16 Jede Cauchy-Folge ist beschränkt.

Beweis: Wenn $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Cauchy-Folge ist, dann finden wir eine Zahl K , so dass für alle natürlichen Zahlen m, n , die größer-gleich K sind, die Ungleichung

$$|a_n - a_m| < 1$$

gilt. Sei nun h eine natürliche Zahl, die größer als K ist. Wir definieren

$$S := \max\{|a_0|, |a_1|, |a_2|, \dots, |a_h|, 1 + |a_h|\}$$

und zeigen, dass S eine Schranke der Cauchy-Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist, wir zeigen also

$$\forall n \in \mathbb{N} : |a_n| \leq S.$$

Falls $n \leq h$ ist, ist diese Ungleichung evident. Für alle $n > h$ haben wir die folgende Abschätzung:

$$\begin{aligned} |a_n| &= |a_n - a_h + a_h| \\ &\leq |a_n - a_h| + |a_h| \\ &< 1 + |a_h| \\ &\leq S. \end{aligned}$$

Damit ist der Beweis abgeschlossen. \square

Theorem 17 Jede Cauchy-Folge ist konvergent.

Beweis: Der Beweis verläuft ähnlich wie der Nachweis, dass eine monotone und beschränkte Folge konvergent ist. Wir definieren zunächst ein Paar von Mengen $\langle M_1, M_2 \rangle$ wie folgt:

1. $M_1 := \{x \in \mathbb{R} \mid \exists K \in \mathbb{N} : \forall n \in \mathbb{N} : n \geq K \rightarrow x \leq a_n\}$.

Anschaulich ist M_1 die Menge aller unteren Grenzen für die Mehrheit der Folgenglieder: Ist $x \in M_1$, so müssen von einem bestimmten Index K an alle weiteren Folgenglieder a_n durch x nach unten abgeschätzt werden.

Die Beschränktheit der Cauchy-Folge impliziert, dass die Menge M_1 nicht leer ist, denn wenn für alle $n \in \mathbb{N}$ die Ungleichung $|a_n| \leq S$ gilt, dann gilt insbesondere $-S \leq a_n$ und daraus folgt $-S \in M_1$.

2. Da das Paar $\langle M_1, M_2 \rangle$ eine Dedekind'scher Schnitt werden soll, definieren wir M_2 als das Komplement von M_1 in \mathbb{R} :

$$\begin{aligned} M_2 &:= \mathbb{R} \setminus M_1 \\ &= \mathbb{R} \setminus \{x \in \mathbb{R} \mid \exists K \in \mathbb{N} : \forall n \in \mathbb{N} : n \geq K \rightarrow x \leq a_n\} \\ &= \{x \in \mathbb{R} \mid \neg \exists K \in \mathbb{N} : \forall n \in \mathbb{N} : n \geq K \rightarrow x \leq a_n\} \\ &= \{x \in \mathbb{R} \mid \forall K \in \mathbb{N} : \exists n \in \mathbb{N} : n \geq K \wedge a_n < x\} \end{aligned}$$

Die Menge M_2 enthält also alle die reellen Zahlen x , für die wir Folgenglieder a_n mit beliebig großem Index n finden können, die kleiner als x sind.

Auch M_2 ist nicht leer. Dies folgt wieder aus der Beschränktheit von $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$, denn wenn für alle $n \in \mathbb{N}$ die Ungleichung $|a_n| \leq S$ erfüllt ist, dann gilt offenbar $S + 1 \in M_2$.

Als nächstes zeigen wir, dass

$$\forall x_1 \in M_1 : \forall x_2 \in M_2 : x_1 < x_2$$

gilt. Wegen $x_1 \in M_1$ gibt es nach Definition von M_1 eine natürliche Zahl K , so dass alle Folgenglieder a_n , deren Index $n \geq K$ ist, die Ungleichung

$$x_1 \leq a_n \tag{2.7}$$

erfüllen. Wegen $x_2 \in M_2$ gibt es nach Definition von M_2 dann eine natürliche Zahl $n_0 \geq K$, so dass

$$a_{n_0} < x_2 \tag{2.8}$$

gilt. Für dieses n_0 gilt natürlich auch die Ungleichung (2.7), so dass wir insgesamt

$$x_1 \leq a_{n_0} < x_2$$

und damit

$$x_1 < x_2$$

haben. Damit ist das Paar $\langle M_1, M_2 \rangle$ ein Dedekind'scher Schnitt. Aus dem Vollständigkeits-Axioms folgt nun, dass eine Trennungs-Zahl s mit der Eigenschaft

$$\forall x_1 \in M_1 : x_1 \leq s \quad \text{und} \quad \forall x_2 \in M_2 : s \leq x_2$$

existiert. Wir zeigen, dass

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = s$$

gilt. Sei $\varepsilon > 0$ gegeben. Wir suchen eine Zahl K , so dass für alle natürlichen Zahlen $n \geq K$ die Ungleichung

$$|a_n - s| < \varepsilon$$

gilt. Wir betrachten zunächst die Zahl $s - \frac{\varepsilon}{2}$. Wegen $s - \frac{\varepsilon}{2} < s$ folgt $s - \frac{\varepsilon}{2} \in M_1$. Damit existiert dann eine Zahl K_1 , so dass für alle $n \in \mathbb{N}$ mit $n \geq K_1$ die Ungleichung

$$s - \frac{\varepsilon}{2} \leq a_n \tag{2.9}$$

gilt. Da die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Cauchy-Folge ist, gibt es eine Zahl K_2 , so dass für alle $m, n \in \mathbb{N}$ mit $m > K_2$ und $n > K_2$ die Ungleichung

$$|a_n - a_m| < \frac{\varepsilon}{2} \tag{2.10}$$

gilt. Wir setzen nun $K = \max(K_1, K_2)$ und betrachten die Zahl $s + \frac{\varepsilon}{2}$, die wegen $s < s + \frac{\varepsilon}{2}$ sicher in M_2 liegt. Nach Definition von M_2 finden wir dann eine natürliche Zahl m , die größer als K ist, so dass

$$a_m < s + \frac{\varepsilon}{2} \tag{2.11}$$

gilt. Für diese Zahl m gilt sicher auch die Ungleichung (2.9), so dass wir insgesamt

$$s - \frac{\varepsilon}{2} \leq a_m < s + \frac{\varepsilon}{2}$$

haben. Daraus folgt sofort

$$|a_m - s| \leq \frac{\varepsilon}{2}. \tag{2.12}$$

Aufgrund der Ungleichung (2.10) haben wir jetzt für alle natürlichen Zahlen $n > K$:

$$\begin{aligned} |a_n - s| &= |(a_n - a_m) + (a_m - s)| \\ &\leq |(a_n - a_m)| + |(a_m - s)| \\ &< \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon}{2} \\ &= \varepsilon \end{aligned}$$

Damit ist der Beweis abgeschlossen. □

2.2 Berechnung der Quadrat-Wurzel

Wir präsentieren nun eine Anwendung der bisher entwickelte Theorie und zeigen, wie die Quadrat-Wurzel einer reellen Zahl berechnet werden kann. Es sei eine reelle Zahl $a > 0$ gegeben. Gesucht ist eine reelle Zahl $b > 0$, so dass $b^2 = a$ ist. Unsere Idee ist es, die Zahl b iterativ als Lösung einer Fixpunkt-Gleichung zu berechnen. Wir definieren eine Folge b_n induktiv wie folgt:

I.A.: $n = 0$.

$$b_0 := \begin{cases} 1 & \text{falls } a \leq 1, \\ a & \text{sonst.} \end{cases}$$

I.S.: $n \mapsto n + 1$.

$$b_{n+1} := \frac{1}{2} \cdot \left(b_n + \frac{a}{b_n} \right).$$

Um diese Definition zu verstehen, nehmen wir zunächst an, dass der Grenzwert dieser Folge existiert und den Wert $b \neq 0$ hat. Dann gilt

$$\begin{aligned} b &= \lim_{n \rightarrow \infty} b_n \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} b_{n+1} \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{2} \cdot \left(b_n + \frac{a}{b_n} \right) \\ &= \frac{1}{2} \cdot \left(\lim_{n \rightarrow \infty} b_n + \frac{a}{\lim_{n \rightarrow \infty} b_n} \right) \\ &= \frac{1}{2} \cdot \left(b + \frac{a}{b} \right) \end{aligned}$$

Damit ist b also eine Lösung der Gleichung $b = \frac{1}{2} \cdot \left(b + \frac{a}{b} \right)$. Wir formen diese Gleichung um:

$$\begin{aligned} b &= \frac{1}{2} \cdot \left(b + \frac{a}{b} \right) & | \cdot 2 \\ \Leftrightarrow & 2 \cdot b = b + \frac{a}{b} & | -b \\ \Leftrightarrow & b = \frac{a}{b} & | \cdot b \\ \Leftrightarrow & b^2 = a & | \sqrt{} \\ \Leftrightarrow & b = \sqrt{a} \end{aligned}$$

Falls die oben definierte Folge $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ einen Grenzwert hat, dann ist dieser Grenzwert also die Wurzel der Zahl a . Wir werden die Konvergenz der Folge nachweisen indem wir zeigen, dass die Folge $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ einerseits monoton fallend und andererseits nach unten beschränkt ist. Dazu betrachten wir zunächst die Differenz $b_{n+1}^2 - a$:

$$\begin{aligned} b_{n+1}^2 - a &= \frac{1}{4} \cdot \left(b_n + \frac{a}{b_n} \right)^2 - a \\ &= \frac{1}{4} \cdot \left(b_n^2 + 2 \cdot a + \frac{a^2}{b_n^2} \right) - a \\ &= \frac{1}{4} \cdot \left(b_n^2 - 2 \cdot a + \frac{a^2}{b_n^2} \right) \\ &= \frac{1}{4} \cdot \left(b_n - \frac{a}{b_n} \right)^2 \\ &\geq 0, \end{aligned}$$

denn das Quadrat einer reellen Zahl ist immer größer-gleich Null. Addieren wir auf beiden Seiten der Ungleichung

$$b_{n+1}^2 - a \geq 0$$

die Zahl a , so haben wir

$$b_{n+1}^2 \geq a \quad \text{und damit auch} \quad b_{n+1} \geq \sqrt{a} \quad \text{für alle } n \in \mathbb{N}$$

gezeigt. Nach unserer Definition der Folge $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gilt diese Ungleichung auch für den ersten Wert $n = 0$, so dass wir also insgesamt die Ungleichung

$$b_n^2 \geq a \quad \text{und} \quad b_n \geq \sqrt{a} \quad \text{für alle } n \in \mathbb{N}$$

gezeigt haben. Daraus folgt, dass \sqrt{a} eine untere Schranke der Folge $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist. Dividieren wir die erste Ungleichung durch b_n , so folgt

$$b_n \geq \frac{a}{b_n}.$$

Die Zahl $\frac{1}{2} \cdot \left(b_n + \frac{a}{b_n} \right)$ ist der arithmetische Mittelwert der Zahlen b_n und $\frac{a}{b_n}$ und muss daher zwischen diesen beiden Zahlen liegen:

$$b_n \geq \frac{1}{2} \cdot \left(b_n + \frac{a}{b_n} \right) \geq \frac{a}{b_n}.$$

Dieser Mittelwert ist aber gerade b_{n+1} , es gilt also

$$b_n \geq b_{n+1} \geq \frac{a}{b_n}.$$

Dies zeigt, dass die Folge $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ monoton fallend ist und damit muß die Folge auch konvergieren. Wir hatten oben schon gezeigt, dass der Grenzwert dieser Folge dann den Wert \sqrt{a} haben muss, es gilt also

$$\lim_{n \rightarrow \infty} b_n = \sqrt{a}$$

Abbildung 2.2 auf Seite 21 zeigt die Definition einer Prozedur `mySqrt()` in SETLX, die die ersten 9 Glieder der Folge berechnet und dann jeweils mit Hilfe der Funktion `nDecimalPlaces()` die ersten 100 Stellen der Werte ausgibt.

Die von diesem Programm berechnete Ausgabe ist in Abbildung 2.3 gezeigt. Sie können sehen, dass die Folge sehr schnell konvergiert. b_2 stimmt auf 2 Stellen hinter dem Komma mit dem Ergebnis überein, bei b_3 sind es bereits 5 Stellen, bei b_4 sind es 11 Stellen, bei b_5 sind es 23 Stellen, bei b_6 sind es 47 Stellen, bei b_7 haben wir 96 Stellen und ab dem Folgeglied b_8 ändern sich die ersten 100 Stellen hinter dem Komma nicht mehr.

In modernen Mikroprozessoren wird übrigens eine verfeinerte Version des in diesem Abschnitt beschriebenen Verfahrens eingesetzt. Die Verfeinerung besteht im wesentlichen darin, dass zunächst ein guter Startwert b_0 in einer Tabelle nachgeschlagen wird, die restlichen Folgeglieder werden dann in der Tat über die Rekursionsformel $b_{n+1} = \frac{1}{2} \cdot \left(b_n + \frac{a}{b_n} \right)$ berechnet.

Abbildung 2.2: Ein *SetlX*-Programm zur iterativen Berechnung der Quadrat-Wurzel.

Abbildung 2.3: Berechnung der Quadrat-Wurzel mit Hilfe der Folge $b_{n+1} = \frac{1}{2} \cdot (b_n + \frac{a}{b_n})$.

2.3 Reihen

Definition 18 (Reihe) Ist $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Folge, so definieren wir die Folge der *Partial-Summen* $(s_n)_{n \in \mathbb{N}}$ durch die Festsetzung

$$s_n := \sum_{i=0}^n a_i.$$

Diese Folge bezeichnen wir auch als unendliche *Reihe*. Die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ bezeichnen wir als die der Reihe $(\sum_{i=0}^n a_i)_{n \in \mathbb{N}}$ *zugrunde liegende Folge*. Falls die Folge der Partial-Summen konvergiert, so schreiben wir den Grenzwert als

$$\sum_{i=0}^{\infty} a_i := \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{i=0}^n a_i.$$

Gelegentlich treten in der Praxis Folgen $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ auf, für welche die Folgenglieder a_i erst ab einem Index $k > 0$ definiert sind. Beispielsweise ist die Folge $\left(\frac{1}{n}\right)_{n \in \mathbb{N}}$ erst ab $k = 1$ definiert. Um auch aus solchen Folge bequem Reihen bilden zu können, definieren wir in einem solchen Fall die Partial-Summen s_n durch

$$s_n = \sum_{i=k}^n a_i,$$

wobei wir vereinbaren, dass $\sum_{i=k}^n a_i = 0$ ist, falls $k > n$ ist.

Satz 19 (Bernoullische Ungleichung) Es sei $x \in \mathbb{R}$, $n \in \mathbb{N}$ und es gelte $x \geq -1$. Dann gilt

$$(1+x)^n \geq 1 + n \cdot x.$$

Diese Ungleichung wird als *Bernoullische Ungleichung* (Jakob Bernoulli, 1655-1705) bezeichnet.

Beweis: Wir beweisen die Ungleichung durch vollständige Induktion nach n .

I.A.: $n = 0$. Es gilt

$$(1+x)^0 = 1 \geq 1 = 1 + 0 \cdot x. \quad \checkmark$$

I.S.: $n \mapsto n+1$. Nach Induktions-Voraussetzung gilt

$$(1+x)^n \geq 1 + n \cdot x \tag{2.13}$$

Da $x \geq -1$ ist, folgt $1+x \geq 0$ positiv, so dass wir die Ungleichung 2.13 mit $1+x$ multiplizieren können. Dann erhalten wir die folgende Ungleichungs-Kette

$$\begin{aligned} (1+x)^{n+1} &\geq (1+n \cdot x) \cdot (1+x) \\ &= 1 + (n+1) \cdot x + n \cdot x^2 \\ &\geq 1 + (n+1) \cdot x \end{aligned}$$

Also haben wir insgesamt

$$(1+x)^{n+1} \geq 1 + (n+1) \cdot x$$

gezeigt. □

Satz 20 Es sei $q \in \mathbb{R}$ mit $|q| < 1$. Dann gilt

$$\lim_{n \rightarrow \infty} q^n = 0.$$

Beweis: Wir nehmen zunächst an, dass q positiv ist. Aus $q < 1$ folgt dann

$$1 < \frac{1}{q} \quad \text{und damit} \quad 0 < \frac{1}{q} - 1.$$

Wir definieren nun

$$x := \frac{1}{q} - 1.$$

Mit Hilfe der Bernoullischen Ungleichung sehen wir nun, dass Folgendes gilt:

$$\begin{aligned} \frac{1}{q^n} &= \left(1 + \left(\frac{1}{q} - 1\right)\right)^n \\ &\geq 1 + n \cdot \left(\frac{1}{q} - 1\right) \\ &= 1 + n \cdot x. \end{aligned}$$

Durch Invertierung dieser Ungleichung erhalten wir

$$q^n \leq \frac{1}{1 + n \cdot x}$$

Ist nun ein $\varepsilon > 0$ gegeben, so definieren wir

$$K := \left(\frac{1}{\varepsilon} - 1\right) \cdot \frac{1}{x} + 1.$$

Dann gilt für alle $n \geq K$:

$$\begin{aligned} \left(\frac{1}{\varepsilon} - 1\right) \cdot \frac{1}{x} + 1 &\leq n \\ \Rightarrow \left(\frac{1}{\varepsilon} - 1\right) \cdot \frac{1}{x} &< n \\ \Rightarrow \left(\frac{1}{\varepsilon} - 1\right) &< n \cdot x \\ \Rightarrow \frac{1}{\varepsilon} &< 1 + n \cdot x \\ \Rightarrow \frac{1}{1 + n \cdot x} &< \varepsilon \end{aligned}$$

Insgesamt haben wir nun für alle $n \geq K$ gezeigt, dass

$$0 < q^n \leq \frac{1}{1 + n \cdot x} < \varepsilon$$

gilt, also haben wir für $n \geq K$

$$|q^n| < \varepsilon.$$

Für $q = 0$ ist diese Ungleichung offenbar auch gültig und wenn q negativ ist, gilt $-q > 0$, so dass die Ungleichung für $-q$ gilt:

$$|(-q)^n| < \varepsilon.$$

Wegen $|(-q)^n| = |q^n|$ folgt daraus also, dass für alle q die Ungleichung

$$|q^n| < \varepsilon \quad \text{für } n \geq K$$

gültig ist und damit ist die Behauptung bewiesen. □

Wir präsentieren nun einige Beispiele für konvergente Reihen:

1. Wir betrachten die Folge $\left(\frac{1}{n \cdot (n+1)}\right)_{n \in \mathbb{N}}$, die nur für $n \geq 1$ definiert ist. Für die Partial-Summen zeigen wir durch Induktion über n , dass gilt:

$$\sum_{i=1}^n \frac{1}{i \cdot (i+1)} = 1 - \frac{1}{n+1} \quad (2.14)$$

- (a) (Induktions-Anfang) $n = 1$: Einerseits haben wir für $n = 1$

$$\sum_{i=1}^n \frac{1}{i \cdot (i+1)} = \sum_{i=1}^1 \frac{1}{i \cdot (i+1)} = \frac{1}{1 \cdot (1+1)} = \frac{1}{2},$$

andererseits gilt

$$1 - \frac{1}{n+1} = 1 - \frac{1}{1+1} = 1 - \frac{1}{2} = \frac{1}{2}.$$

- (b) (Induktions-Schritt) $n \mapsto n+1$:

$$\begin{aligned} \sum_{i=1}^{n+1} \frac{1}{i \cdot (i+1)} &= \sum_{i=1}^n \frac{1}{i \cdot (i+1)} + \frac{1}{(n+1) \cdot (n+2)} \\ &\stackrel{IV}{=} 1 - \frac{1}{(n+1)} + \frac{1}{(n+1) \cdot (n+2)} \\ &= 1 - \frac{n+2-1}{(n+1) \cdot (n+2)} \\ &= 1 - \frac{n+1}{(n+1) \cdot (n+2)} \\ &= 1 - \frac{1}{n+2} \end{aligned}$$

Aus Gleichung (2.14) folgt nun sofort

$$\sum_{i=1}^{\infty} \frac{1}{i \cdot (i+1)} = \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^n \frac{1}{i \cdot (i+1)} = \lim_{n \rightarrow \infty} \left(1 - \frac{1}{n+1}\right) = 1.$$

2. Wir betrachten die Folge $(q^n)_{n \in \mathbb{N}}$ für eine Zahl $q \in \mathbb{R}$. Für die Partial-Summen gilt

$$s_n = \sum_{i=0}^n q^i.$$

Wir betrachten den Ausdruck $(1-q) \cdot s_n$:

$$\begin{aligned} (1-q) \cdot s_n &= (1-q) \cdot \sum_{i=0}^n q^i \\ &= \sum_{i=0}^n q^i - q \cdot \sum_{i=0}^n q^i \\ &= \sum_{i=0}^n q^i - \sum_{i=0}^n q^{i+1} \\ &= \sum_{i=0}^n q^i - \sum_{i=1}^{n+1} q^i \\ &= \left(q^0 + \sum_{i=1}^n q^i\right) - \left(\sum_{i=1}^n q^i + q^{n+1}\right) \\ &= q^0 - q^{n+1} \\ &= 1 - q^{n+1} \end{aligned}$$

Es gilt also

$$(1 - q) \cdot \sum_{i=0}^n q^i = 1 - q^{n+1}$$

Dividieren wir diese Gleichung durch $(1 - q)$, so erhalten wir für die Partial-Summen den Ausdruck

$$\sum_{i=0}^n q^i = \frac{1 - q^{n+1}}{1 - q}.$$

Falls $|q| < 1$ ist, konvergiert die Folge $(q^n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegen 0. Damit gilt für $|q| < 1$

$$\sum_{i=0}^{\infty} q^i = \frac{1}{1 - q}.$$

Die Reihe $\left(\sum_{i=0}^n q^i\right)_{n \in \mathbb{N}}$ wird als *geometrische Reihe* bezeichnet.

Definition 21 (Alternierende Reihe) Hat eine Reihe die Form

$$\left(\sum_{i=0}^n (-1)^i \cdot a_i\right)_{n \in \mathbb{N}}$$

und gilt entweder

$$\forall i \in \mathbb{N} : a_i \geq 0 \quad \text{oder} \quad \forall i \in \mathbb{N} : a_i \leq 0$$

so sprechen wir von einer *alternierenden Reihe*.

Beispiel:

$$\left(\sum_{i=1}^n \frac{(-1)^i}{i}\right)_{n \in \mathbb{N}} \quad \text{ist eine alternierende Reihe.}$$

Definition 22 (Null-Folge) Die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist eine *Null-Folge* wenn gilt:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = 0.$$

Satz 23 (Leibniz-Kriterium, (Gottfried Wilhelm Leibniz, 1646-1716))

Wenn die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine monoton fallende Null-Folge ist, dann konvergiert die alternierende Reihe

$$\left(\sum_{i=0}^n (-1)^i \cdot a_i\right)_{n \in \mathbb{N}}.$$

Beweis: Die Partial-Summen s_n sind durch

$$s_n = \sum_{i=0}^n (-1)^i \cdot a_i$$

definiert. Wir betrachten zunächst die Folge der Partial-Summen mit geraden Indizes, wir betrachten also die Folge $(s_{2n})_{n \in \mathbb{N}}$ und zeigen, dass diese Folge monoton fallend ist. Es gilt

$$s_{2 \cdot (n+1)} = s_{2 \cdot n} + (-1)^{2 \cdot n+1} \cdot a_{2 \cdot n+1} + (-1)^{2 \cdot n+2} \cdot a_{2 \cdot n+2} = s_{2 \cdot n} - a_{2 \cdot n+1} + a_{2 \cdot n+2}. \quad (2.15)$$

Daraus folgt

$$\begin{aligned} s_{2 \cdot (n+1)} &\leq s_{2 \cdot n} \\ \Leftrightarrow s_{2 \cdot n} - a_{2 \cdot n+1} + a_{2 \cdot n+2} &\leq s_{2 \cdot n} \\ \Leftrightarrow a_{2 \cdot n+2} &\leq a_{2 \cdot n+1} \end{aligned}$$

Die letzte Ungleichung ist aber nicht anderes als die Monotonie der Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$.

Als nächstes zeigen wir durch vollständige Induktion, dass die Folge der Partial-Summen mit geraden Indizes nach unten beschränkt ist, genauer gilt

$$s_{2 \cdot n} \geq a_0 - a_1.$$

Um dies nachzuweisen, zeigen wir durch vollständige Induktion, dass für alle $n \in \mathbb{N}$ gilt:

$$s_{2 \cdot n+1} \geq a_0 - a_1.$$

I.A.: $n = 0$.

$$s_{2 \cdot 0+1} = s_1 = a_0 - a_1.$$

I.S.: $n \mapsto n + 1$

$$\begin{aligned} s_{2 \cdot (n+1)+1} &= s_{2 \cdot n+1} + a_{2 \cdot n+2} - a_{2 \cdot n+3} \\ &\geq a_0 - a_1 + a_{2 \cdot n+2} - a_{2 \cdot n+3} \quad \text{nach Induktions-Voraussetzung} \\ &\geq a_0 - a_1 \quad \text{wegen } a_{2 \cdot n+2} \geq a_{2 \cdot n+3}. \end{aligned}$$

Nun gilt für $n \geq 1$

$$s_{2 \cdot n} = s_{2 \cdot n-1} + a_{2 \cdot n} \geq s_{2 \cdot n-1} \geq a_0 - a_1$$

und für $n = 0$ ist $s_0 = a_0 \geq a_0 - a_1$. Da wir nun gezeigt haben, dass die Folge $(s_{2 \cdot n})_{n \in \mathbb{N}}$ sowohl monoton fallend als auch nach unten beschränkt ist, folgt aus Satz 12, dass diese Folge konvergent ist. Der Grenzwert dieser Folge sei s :

$$s := \lim_{n \rightarrow \infty} s_{2 \cdot n}.$$

Dann konvergiert auch die Folge $(s_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegen s . Dies sehen wir wie folgt: Sei $\varepsilon > 0$ gegeben. Weil $(s_{2 \cdot n})_{n \in \mathbb{N}}$ gegen s konvergiert gibt es eine Zahl K_1 , so dass für alle $n > K_1$ die Ungleichung

$$|s_{2 \cdot n} - s| < \frac{1}{2} \cdot \varepsilon \tag{2.16}$$

erfüllt ist. Weil $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Null-Folge ist gibt es außerdem eine Zahl K_2 , so dass für alle $n > K_2$ die Ungleichung

$$|a_n - 0| < \frac{1}{2} \cdot \varepsilon \tag{2.17}$$

gilt. Wir setzen $K := \max(2 \cdot K_1 + 1, K_2)$ und zeigen, dass für alle $n > K$ die Ungleichung

$$|s_n - s| < \varepsilon$$

gilt. Wir erbringen diesen Nachweis über eine Fall-Unterscheidung:

1. n ist gerade, also gilt $n = 2 \cdot m$.

$$\begin{aligned} |s_n - s| &= |s_{2 \cdot m} - s| \\ &< \frac{1}{2} \cdot \varepsilon \\ &< \varepsilon, \end{aligned}$$

denn aus $n = 2 \cdot m$ und $n > K$ folgt $m > K_1$.

2. n ist ungerade, also gilt $n = 2 \cdot m + 1$.

$$\begin{aligned}
 |s_n - s| &= |s_{2 \cdot m + 1} - s| \\
 &= |s_{2 \cdot m + 1} - s_{2 \cdot m} + s_{2 \cdot m} - s| \\
 &\leq |s_{2 \cdot m + 1} - s_{2 \cdot m}| + |s_{2 \cdot m} - s| \\
 &< |a_{2 \cdot m + 1}| + \frac{1}{2} \cdot \varepsilon \\
 &< \frac{1}{2} \cdot \varepsilon + \frac{1}{2} \cdot \varepsilon \\
 &= \varepsilon,
 \end{aligned}$$

denn aus $n = 2 \cdot m + 1$ und $n > K$ folgt $m > K_1$ und $n > K_2$.

Damit ist der Beweis abgeschlossen. \square

Aufgabe 9: Wenn die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine monoton fallende Null-Folge ist, dann gilt für den Grenzwert der zugehörigen alternierende Reihe

$$\sum_{i=0}^{\infty} (-1)^i \cdot a_i \leq a_0.$$

Hinweis: Zeigen Sie durch vollständige Induktion über n , dass für die Partial-Summen s_n gilt:

$$s_n \leq a_0.$$

Lösung:

I.A.: $n = 0$.

$$s_0 = a_0 \leq a_0.$$

I.S.: $n \mapsto n + 1$.

Wir führen eine Fall-Unterscheidung durch:

(a) n ist gerade, also gilt $n = 2 \cdot m$ für ein geeignetes $m \in \mathbb{N}$.

$$\begin{aligned}
 s_{n+1} &= s_{2 \cdot m + 1} \\
 &= s_{2 \cdot m} + (-1)^{2 \cdot m + 1} \cdot a_{2 \cdot m + 1} \\
 &= s_n - a_{2 \cdot m + 1} \\
 &\leq a_0 - a_{2 \cdot m + 1} && \text{nach Induktions-Voraussetzung} \\
 &\leq a_0 && \text{denn } a_{2 \cdot m + 1} \geq 0
 \end{aligned}$$

(b) n ist ungerade, also gilt $n = 2 \cdot m + 1$ für ein geeignetes $m \in \mathbb{N}$.

$$\begin{aligned}
 s_{n+1} &= s_{2 \cdot m + 2} \\
 &= s_{2 \cdot m + 1} + (-1)^{2 \cdot m + 2} \cdot a_{2 \cdot m + 2} \\
 &= s_n + a_{2 \cdot m + 2} \\
 &\leq s_n && \text{denn } a_{2 \cdot m + 2} \leq 0 \\
 &\leq a_0 && \text{nach IV}
 \end{aligned}$$

Die Behauptung folgt nun aus der Tatsache, dass \leq -Beziehungen zwischen konvergenten Folgen für die Grenzwerte erhalten bleiben.

Satz 24 (Cauchy'sches Konvergenz-Kriterium für Reihen)

Die Reihe $\left(\sum_{i=0}^n a_i\right)_{n \in \mathbb{N}}$ ist genau dann konvergent, wenn es für alle $\varepsilon > 0$ eine Zahl K gibt, so dass gilt:

$$\forall n, l \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow \left| \sum_{i=n+1}^{n+l} a_i \right| < \varepsilon.$$

Beweis: Nach den Sätzen aus dem Abschnitt über Folgen ist die Folge $(s_n)_{n \in \mathbb{N}}$ der durch

$$s_n = \sum_{i=0}^n a_i$$

definierten Partial-Summen genau dann konvergent, wenn $(s_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Cauchy-Folge ist, wenn also gilt:

$$\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \exists K \in \mathbb{R} : \forall m, n \in \mathbb{N} : m > K \wedge n > K \rightarrow |s_m - s_n| < \varepsilon.$$

In der letzten Formel können wir ohne Einschränkung der Allgemeinheit annehmen, dass $n \leq m$ gilt. Dann ist $m = n+l$ für eine natürliche Zahl l . Setzen wir hier die Definition der Partial-Summen ein, so erhalten wir

$$\begin{aligned} |s_m - s_n| &= |s_{n+l} - s_n| \\ &= \left| \sum_{i=0}^{n+l} a_i - \sum_{i=0}^n a_i \right| \\ &= \left| \sum_{i=n+1}^{n+l} a_i \right| \end{aligned}$$

und damit ist klar, dass die Ungleichung des Satzes äquivalent dazu ist, dass die Folge der Partial-Summen eine Cauchy-Folge ist. \square

Korollar 25

Wenn die Reihe $\left(\sum_{i=0}^n a_n\right)_{n \in \mathbb{N}}$ konvergent ist, dann ist die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Null-Folge.

Beweis: Nach dem Cauchy'schen Konvergenz-Kriterium gilt

$$\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \exists K \in \mathbb{R} : \forall n, l \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow \left| \sum_{i=n+1}^{n+l} a_i \right| < \varepsilon.$$

Setzen wir hier $l = 1$ so haben wir insbesondere

$$\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \exists K \in \mathbb{R} : \forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow \left| \sum_{i=n+1}^{n+1} a_i \right| < \varepsilon.$$

Wegen

$$\left| \sum_{i=n+1}^{n+1} a_i \right| = |a_{n+1}|$$

folgt also

$$\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \exists K \in \mathbb{R} : \forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow |a_{n+1}| < \varepsilon.$$

Diese Formel drückt aus, dass $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Null-Folge ist. \square

Mit Hilfe des letzten Satzes können wir zeigen, dass die *harmonische Reihe*

$$\left(\sum_{i=0}^n \frac{1}{i}\right)_{n \in \mathbb{N}}$$

divergiert. Wäre diese Reihe konvergent, so gäbe es nach dem Cauchy'schen Konvergenz-Kriterium eine Zahl K , so dass für alle $n > K$ und alle l die Ungleichung

$$\sum_{i=n+1}^{n+l} \frac{1}{i} < \frac{1}{2}$$

gilt. Insbesondere würde diese Ungleichung dann für $l = n$ gelten. Für beliebige n gilt aber die folgende Abschätzung:

$$\sum_{i=n+1}^{n+n} \frac{1}{i} \geq \sum_{i=n+1}^{2 \cdot n} \frac{1}{2 \cdot n} = n \cdot \frac{1}{2 \cdot n} = \frac{1}{2}$$

Damit erfüllt die harmonische Reihe das Cauchy'sche Konvergenz-Kriterium nicht.

Satz 26 (Majoranten-Kriterium) Für die Folgen $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gelte:

1. $\forall n \in \mathbb{N} : 0 \leq a_n \leq b_n$.
2. Der Grenzwert $\sum_{i=0}^{\infty} b_i$ existiert.

Dann existiert auch der Grenzwert $\sum_{i=0}^{\infty} a_i$.

Beweis: Es gilt

$$\sum_{i=0}^n a_i \leq \sum_{i=0}^n b_i \leq \sum_{i=0}^{\infty} b_i.$$

Also ist die Folge $\left(\sum_{i=0}^n a_i \right)_{n \in \mathbb{N}}$ monoton wachsend und beschränkt und damit konvergent.

Bemerkung: Oft wird im Majoranten-Kriterium die Voraussetzung $\forall n \in \mathbb{N} : 0 \leq a_n \leq b_n$ abgeschwächt zu

$$\forall n \in \mathbb{N} : n \geq K \rightarrow 0 \leq a_n \leq b_n.$$

Hierbei ist K dann eine geeignet gewählte Schranke. Die Gültigkeit dieser Form des Majoranten-Kriteriums folgt aus der Tatsache, dass das Abändern endlich vieler Glieder einer Reihe für die Frage, ob eine Reihe konvergent ist, unbedeutend ist.

Aufgabe 10: Zeigen Sie mit dem Majoranten-Kriterium, dass die Reihe $\left(\sum_{i=1}^n \frac{1}{i^2} \right)_{n \in \mathbb{N}}$ konvergiert.

Lösung: Es gilt

$$\begin{aligned} i+1 &\geq i & | \cdot (i+1) \\ \Rightarrow (i+1)^2 &\geq i \cdot (i+1) & | \cdot \frac{1}{i \cdot (i+1)} \\ \Rightarrow \frac{1}{(i+1)^2} &\leq \frac{1}{i \cdot (i+1)} \end{aligned}$$

Damit ist die Reihe $\left(\sum_{i=1}^n \frac{1}{i \cdot (i+1)} \right)_{n \in \mathbb{N}}$ eine konvergente Majorante der Reihe $\left(\sum_{i=1}^n \frac{1}{(i+1)^2} \right)_{n \in \mathbb{N}}$.
Wegen

$$\sum_{i=1}^{\infty} \frac{1}{i^2} = \frac{1}{1^2} + \sum_{i=1}^{\infty} \frac{1}{(i+1)^2}$$

folgt die Konvergenz aus dem Majoranten-Kriterium.

Bemerkung: Wir werden später zeigen, dass

$$\sum_{i=1}^{\infty} \frac{1}{i^2} = \frac{\pi^2}{6} \quad \text{gilt.}$$

Satz 27 (Minoranten-Kriterium) Für die Folgen $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gelte:

1. $\forall n \in \mathbb{N} : 0 \leq a_n \leq b_n$.
2. Der Grenzwert $\sum_{i=0}^{\infty} a_i$ existiert nicht.

Dann existiert auch der Grenzwert $\sum_{i=0}^{\infty} b_i$ nicht.

Beweis: Wir führen den Beweis indirekt und nehmen an, dass $\sum_{i=0}^{\infty} b_i$ existiert. Nach dem Majoranten-Kriterium müßte dann auch der Grenzwert $\sum_{i=0}^{\infty} a_i$ existieren und das steht im Widerspruch zur Voraussetzung. \square

Aufgabe 11: Zeigen Sie, dass die Reihe

$$\left(\sum_{i=0}^n \frac{1}{\sqrt{i+1}} \right)_{n \in \mathbb{N}}$$

nicht konvergiert.

Lösung: Wir benutzen das Minoranten-Kriterium und zeigen, dass die Reihe $\left(\sum_{i=0}^n \frac{1}{n+1} \right)_{n \in \mathbb{N}}$ eine divergente Minorante der Reihe $\left(\sum_{i=0}^n \frac{1}{\sqrt{n+1}} \right)_{n \in \mathbb{N}}$ ist:

$$\begin{aligned} \frac{1}{n+1} &\leq \frac{1}{\sqrt{n+1}} & | & \frac{1}{\cdot} \\ \Leftrightarrow n+1 &\geq \sqrt{n+1} & | & \cdot^2 \\ \Leftrightarrow (n+1)^2 &\geq n+1 & | & \cdot \frac{1}{n+1} \\ \Leftrightarrow n+1 &\geq 1 & | & -1 \\ \Leftrightarrow n &\geq 0 \end{aligned}$$

Da die letzte Ungleichung offenbar für alle $n \in \mathbb{N}$ wahr ist, ist der Beweis abgeschlossen. \square

Satz 28 (Quotienten-Kriterium) Es sei $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Folge und $q \in \mathbb{R}$ eine Zahl, so dass gilt:

1. $0 \leq q < 1$
2. $\forall n \in \mathbb{N} : 0 \leq a_n$
3. $\forall n \in \mathbb{N} : a_{n+1} \leq q \cdot a_n$

Dann konvergiert die Reihe $\left(\sum_{i=0}^n a_i \right)_{n \in \mathbb{N}}$.

Beweis: Wir zeigen, dass die geometrische Reihe $\left(\sum_{i=0}^n a_0 \cdot q^i \right)_{n \in \mathbb{N}}$ eine konvergente Majorante der Reihe $\left(\sum_{i=0}^n a_n \right)_{n \in \mathbb{N}}$ ist. Dazu zeigen wir durch Induktion über n dass folgendes gilt:

$$\forall n \in \mathbb{N} : a_n \leq a_0 \cdot q^n$$

I.A. : $n = 0$. Wegen $q^0 = 1$ gilt trivialerweise

$$a_0 \leq a_0 \cdot q^0.$$

I.S. : $n \mapsto n + 1$. Es gilt:

$$\begin{aligned} a_{n+1} &\leq q \cdot a_n && \text{nach Voraussetzung} \\ &\leq q \cdot a_0 \cdot q^n && \text{nach Induktions-Voraussetzung} \\ &= a_0 \cdot q^{n+1}. \end{aligned}$$

□

Bemerkung: Beim Quotienten-Kriterium sind eigentlich nur die Beträge der Folgenglieder $|a_n|$ wichtig, denn es läßt sich folgende Verschärfung des Quotienten-Kriteriums zeigen: Ist $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Folge, $q \in \mathbb{R}$ und $K \in \mathbb{R}$, so dass

$$0 \leq q < 1 \quad \wedge \quad \forall n \in \mathbb{N} : n \geq K \rightarrow \left| \frac{a_{n+1}}{a_n} \right| \leq q$$

gilt. Dann konvergiert die Reihe $\left(\sum_{i=0}^n a_n \right)_{n \in \mathbb{N}}$.

Beispiel: Wir zeigen mit Hilfe des Quotienten-Kriteriums, dass die Reihe $\left(\sum_{i=0}^n \frac{z^i}{i!} \right)_{n \in \mathbb{N}}$ für alle $z \in \mathbb{C}$ konvergiert. Für $z = 0$ ist die Konvergenz der Reihe trivial und sonst betrachten wir den Quotienten a_{n+1}/a_n für diese Reihe, setzen $K = 2 \cdot |z|$ und $q = \frac{1}{2}$ und zeigen, dass das Quotienten-Kriterium erfüllt ist, denn für alle $n \geq K$ gilt:

$$\left| \frac{a_{n+1}}{a_n} \right| = \frac{\frac{|z^{n+1}|}{(n+1)!}}{\frac{|z^n|}{n!}} = \frac{|z^{n+1}| \cdot n!}{|z^n| \cdot (n+1)!} = \frac{|z|}{n+1} \leq \frac{|z|}{K} = \frac{|z|}{2 \cdot |z|} = \frac{1}{2}.$$

Satz 29 (Wurzel-Kriterium) Es sei $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Folge und $q \in \mathbb{R}$ eine Zahl, so dass

1. $0 \leq q < 1$
2. $\forall n \in \mathbb{N} : 0 \leq a_n$
3. $\forall n \in \mathbb{N} : n > 0 \rightarrow \sqrt[n]{a_n} \leq q$

gilt. Dann konvergiert die Reihe $\left(\sum_{i=0}^n a_n \right)_{n \in \mathbb{N}}$.

Beweis: Auch hier können wir den Nachweis der Konvergenz dadurch führen indem wir zeigen, dass die geometrische Reihe $\left(\sum_{i=0}^n q^i\right)_{n \in \mathbb{N}}$ eine konvergente Majorante ist: Für $n > 0$ gilt

$$a_n \leq q^n \Leftrightarrow \sqrt[n]{a_n} \leq q. \quad \square$$

Bemerkung: Beim Wurzel-Kriterium sind eigentlich nur die Beträge der Folgenglieder $|a_n|$ wichtig, denn es läßt sich folgende Verschärfung des Quotienten-Kriteriums zeigen: Ist $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Folge, $q \in \mathbb{R}$ und $K \in \mathbb{R}$, so dass

$$0 \leq q < 1 \quad \wedge \quad \forall n \in \mathbb{N} : n \geq K \rightarrow \sqrt[n]{|a_n|} \leq q$$

gilt. Dann konvergiert die Reihe $\left(\sum_{i=0}^n a_i\right)_{n \in \mathbb{N}}$.

Beispiel: Wir zeigen mit dem Wurzel-Kriterium, dass die Reihe $\left(\sum_{i=0}^n \frac{1}{i!}\right)_{n \in \mathbb{N}}$ konvergiert. Wir

setzen $K = 4$ und $q = \frac{1}{2}$. Zunächst können Sie mit vollständiger Induktion leicht zeigen, dass für alle natürlichen Zahlen $n \geq 4$ die Ungleichung $n! \geq 2^n$ gilt. Damit haben wir für $n \geq 4$:

$$\sqrt[n]{\frac{1}{n!}} \leq \frac{1}{2} \quad \Leftrightarrow \quad \frac{1}{n!} \leq \left(\frac{1}{2}\right)^n \quad \Leftrightarrow \quad n! \geq 2^n.$$

2.4 Potenz-Reihen

Es bezeichne x eine Variable und $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ sei eine Folge von Zahlen. Dann bezeichnen wir den Ausdruck

$$\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot x^n$$

als *formale Potenz-Reihe*. Wichtig ist hier, dass x keine feste Zahl ist, sondern eine Variable, für die wir später reelle (oder auch komplexe) Zahlen einsetzen. Wenn wir in einer Potenz-Reihe für x eine feste Zahl einsetzen, wird aus der Potenz-Reihe eine gewöhnliche Reihe. Der Begriff der Potenz-Reihen kann als eine Verallgemeinerung des Begriffs des Polynoms aufgefaßt werden.

Beispiele:

1. $\sum_{n=0}^{\infty} \frac{x^n}{n!}$ ist eine formale Potenz-Reihe. Wir haben oben mit Hilfe des Quotienten-Kriteriums gezeigt, dass diese Reihe für beliebige reelle Zahlen konvergiert.
2. $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{x^n}{n}$ ist eine formale Potenz-Reihe. Setzen wir für x den Wert 1 ein, so erhalten wir die divergente harmonische Reihe. Für $x = -1$ erhalten wir eine alternierende Reihe, die nach dem Leibniz-Kriterium konvergent ist.

In der Theorie der Potenz-Reihen ist die Frage entscheidend, welche Zahlen wir für die Variable x einsetzen können, so dass die Reihe konvergiert. Diese Frage wird durch die folgenden Sätze beantwortet.

Satz 30 Wenn die Potenz-Reihe

$$\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot x^n$$

für einen Wert $u \in \mathbb{C}$ konvergiert, dann konvergiert die Reihe auch für alle $v \in \mathbb{C}$, für die $|v| < |u|$ ist.

Beweis: Da die Reihe $\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot u^n$ konvergiert, folgt aus dem Korollar zum Cauchy'schen Konvergenz-Kriterium, dass die Folge $(a_n \cdot u^n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Null-Folge ist. Also gibt es eine Zahl K , so dass für

alle $n \geq K$ die Ungleichung

$$|a_n \cdot u^n| \leq 1$$

gilt. Wir definieren

$$q := \left| \frac{v}{u} \right|.$$

Aus $|v| < |u|$ folgt $q < 1$. Dann haben wir für alle $n \geq K$ die folgende Abschätzung:

$$|a_n \cdot v^n| = |a_n \cdot u^n| \cdot \left| \frac{v^n}{u^n} \right| = |a_n \cdot u^n| \cdot q^n \leq q^n.$$

Diese Abschätzung zeigt, dass die geometrische Reihe eine konvergente Majorante der Reihe $a_n \cdot v^n$ ist. Damit folgt die Konvergenz der Reihe $\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot v^n$ aus dem Majoranten-Kriterium. \square

Satz 31 Wenn die Potenz-Reihe $\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot x^n$ für einen Wert $u \in \mathbb{C}$ divergiert, dann divergiert die Reihe auch für alle $v \in \mathbb{C}$, für die $|u| < |v|$ ist.

Beweis: Würde die Reihe $\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot v^n$ konvergieren, dann müßte nach Satz 30 auch die Reihe $\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot u^n$ konvergieren. \square

Die letzten beiden Sätze ermöglichen es nun, den Begriff *Konvergenz-Radius* zu definieren. Es sei

$$\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot x^n$$

eine formale Potenz-Reihe. Wenn diese Reihe für alle $x \in \mathbb{C}$ konvergiert, dann sagen wir, dass der Konvergenz-Radius den Wert ∞ hat. Andernfalls definieren wir den Konvergenz-Radius als

$$R := \sup \left\{ |u| \mid u \in \mathbb{C} \wedge \sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot u^n \text{ konvergiert} \right\}.$$

Aus den letzten beiden Sätzen folgt dann:

1. $\forall z \in \mathbb{C} : |z| < R \rightarrow \sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot z^n$ konvergiert.
2. $\forall z \in \mathbb{C} : |z| > R \rightarrow \sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot z^n$ divergiert.

In der Gauß'schen Zahlen-Ebene ist die Menge $\{z \in \mathbb{C} \mid |z| < R\}$ das Innere eines Kreises mit dem Radius R um den Nullpunkt. Der folgende Satz gibt uns eine effektive Möglichkeit, den Konvergenz-Radius zu berechnen.

Satz 32 Es sei

$$\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot z^n$$

eine formale Potenz-Reihe und die Folge

$$\left(\frac{|a_n|}{|a_{n+1}|} \right)_{n \in \mathbb{N}}$$

konvergiere. Dann ist der Konvergenz-Radius R durch folgende Formel gegeben:

$$R = \lim_{n \rightarrow \infty} \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right|.$$

Beweis: Es sei $u \in \mathbb{C}$ mit $|u| < R$. In diesem Fall müssen wir zeigen, dass die Reihe

$$\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot u^n$$

konvergiert. Wir werden diesen Nachweis mit Hilfe Quotienten-Kriteriums erbringen. Wir setzen $q := \frac{|u|}{R} < 1$ und zeigen, dass für alle hinreichend großen n die Ungleichung

$$\frac{|a_{n+1} \cdot u^{n+1}|}{|a_n \cdot u^n|} \leq q$$

erfüllt ist. Aus

$$R = \lim_{n \rightarrow \infty} \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right|$$

folgt, dass es für beliebige $\varepsilon > 0$ eine Zahl K gibt, so dass für alle $n > K$ die Ungleichung

$$\left| \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right| - R \right| < \varepsilon$$

gilt. Wir setzen $\varepsilon := \frac{1}{2}(R - |u|)$. Wir zeigen, dass dann für alle $n > K$ die Ungleichung $\left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right| > \frac{1}{2}(R + |u|)$ gilt:

$$\begin{aligned} & \left| \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right| + \left(R - \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right| \right) \right| = |R| = R \\ \Rightarrow & \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right| + \left| \left(R - \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right| \right) \right| \geq R \\ \Rightarrow & \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right| + \varepsilon > R \\ \Rightarrow & \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right| + \frac{1}{2}(R - |u|) > R \\ \Rightarrow & \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right| > R - \frac{1}{2}(R - |u|) \\ \Rightarrow & \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right| > \frac{1}{2}(R + |u|). \end{aligned}$$

Jetzt können wir zeigen, dass die Reihe $\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot u^n$ das Quotienten-Kriterium erfüllt, denn für alle $n > K$ gilt:

$$\left| \frac{a_{n+1} \cdot u^{n+1}}{a_n \cdot u^n} \right| = \left| \frac{a_{n+1}}{a_n} \right| \cdot |u| = \frac{|u|}{\left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right|} < \frac{|u|}{\frac{1}{2}(R + |u|)} < \frac{|u|}{\frac{1}{2}(R + R)} = \frac{|u|}{R} = q$$

Um den Beweis abzuschließen müssen wir noch zeigen, die Reihe $\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot u^n$ divergiert wenn $R < |u|$ ist. Dies folgt aus der Tatsache, dass die Folge $(a_n \cdot u^n)_{n \in \mathbb{N}}$ für $|u| > R$ keine Null-Folge ist. Die Details bleiben dem Leser überlassen. \square

Bemerkung: Der obige Satz bleibt auch richtig, wenn

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \left| \frac{a_n}{a_{n+1}} \right| = \infty$$

ist, denn dann ist die Potenz-Reihe $\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot x^n$ für alle $u \in \mathbb{C}$ konvergent.

Beispiel: Die Potenz-Reihe $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{x^n}{n}$ hat den Konvergenz-Radius $R = 1$, denn es gilt

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \left| \frac{\frac{1}{n}}{\frac{1}{n+1}} \right| = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{n+1}{n} = 1 + \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} = 1 + 0 = 1.$$

Satz 33 (Hadamard) Es sei $\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot x^n$ eine Potenz-Reihe und die Folge $\left(\sqrt[n]{|a_n|}\right)_{n \in \mathbb{N}}$ konvergiere. Dann gilt

$$\frac{1}{R} = \lim_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n]{|a_n|}.$$

Bemerkung: Setzen wir $\frac{1}{\infty} = 0$, so bleibt die Formel

$$\frac{1}{R} = \lim_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n]{|a_n|}.$$

auch in dem Fall $\lim_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n]{|a_n|} = 0$ richtig, denn dann gilt $R = \infty$.

Beispiel: Die Potenz-Reihe $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{x^n}{n^n}$ hat den Konvergenz-Radius $R = \infty$, denn es gilt

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n]{\frac{1}{n^n}} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} = 0.$$

Kapitel 3

Stetige und differenzierbare Funktionen

3.1 Stetige Funktionen

Wir wollen in diesem Abschnitt präzisieren, wann eine Funktion so *glatt* ist, dass wir sie zeichnen können, ohne dabei den Stift absetzen zu müssen. Für eine glatte Funktion soll außerdem der *Zwischenwert-Satz* gelten. Der Zwischenwert-Satz besagt, dass für eine glatte Funktion

$$f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R},$$

für die es $a, b \in \mathbb{R}$ gibt mit $f(a) < 0$ und $f(b) > 0$, auch ein $c \in \mathbb{R}$ existiert, so dass $f(c) = 0$ ist. Anschaulich ist dieser Satz klar: Ist beispielsweise $a < b$ und zeichne ich die Funktion f in dem Intervall $[a, b]$, so muss der Graph der Funktion an irgendeiner Stelle des Intervalls $[a, b]$ die x -Achse schneiden. Voraussetzung dafür, dass dies tatsächlich so ist, ist aber die Forderung, dass die Funktion f glatt ist, denn wenn wir beispielsweise die Funktion

$$g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$$

betrachten, die durch

$$g(x) := \begin{cases} -1 & \text{falls } x < 0 \\ +1 & \text{falls } x \geq 0 \end{cases}$$

betrachten, so haben wir zwar $g(-1) = -1$ und $g(1) = 1$, aber es gibt kein $x \in [-1, 1]$, für das $g(x) = 0$ wäre. Das liegt daran, dass die Funktion eben nicht *glatt* ist, denn die Funktion hat an der Stelle $x = 0$ einen Sprung. Unser Ziel in diesem Abschnitt ist es, zunächst exakt zu definieren, was wir unter einer glatten Funktion verstehen wollen. In der Mathematik wird an Stelle des Attributs *glatt* der Begriff der *Stetigkeit* verwendet. Um diesen Begriff einführen zu können, bedarf es einer Reihe von zusätzlichen Definitionen, die nun folgen.

Es sei $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Folge und $D \subseteq \mathbb{R}$. Wir sagen, dass *die Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ in D liegt*, wenn für alle $n \in \mathbb{N}$ gilt $x_n \in D$.

Definition 34 (Grenzwert) Es sei $D \subseteq \mathbb{R}$ und $f : D \rightarrow \mathbb{R}$. Weiter sei $\hat{x} \in \mathbb{R}$ und $\lambda \in \mathbb{R}$. Außerdem gebe es mindestens eine Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$, die gegen \hat{x} konvergiert. Dann ist λ der *Grenzwert* der Funktion f im Punkt \hat{x} , wenn für jede in D liegende Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gilt:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = \hat{x} \Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = \lambda.$$

In diesem Fall schreiben wir

$$\lim_{x \rightarrow \hat{x}} f(x) = \lambda.$$

Bemerkung: In der obigen Definition ist nicht gefordert, dass \hat{x} ein Element des Definitions-

bereichs D ist. In vielen interessanten Fällen ist dies auch nicht der Fall, beispielsweise werden wir später zeigen, dass

$$\lim_{x \rightarrow 0} \frac{\sin(x)}{x} = 1$$

gilt. Die Funktion $x \mapsto \frac{\sin(x)}{x}$ ist für $x = 0$ nicht definiert, trotzdem existiert der Grenzwert.

Definition 35 (Stetigkeit) Es sei $D \subseteq \mathbb{R}$ und $f : D \rightarrow \mathbb{R}$. Weiter sei $\hat{x} \in D$. Dann ist die Funktion f *stetig im Punkt \hat{x}* , wenn gilt:

$$\lim_{x \rightarrow \hat{x}} f(x) = f(\hat{x}).$$

Aus den beiden letzten Definitionen folgt, dass eine stetige Funktion mit dem Prozeß der Grenzwert-Bildung vertauschbar ist. Für eine konvergente Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und eine stetige Funktion f gilt

$$f\left(\lim_{n \rightarrow \infty} x_n\right) = \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n).$$

Beispiele:

1. Es sei $c \in \mathbb{R}$. Dann ist die konstante Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, die durch $f(x) := c$ definiert ist, in jedem Punkt $\hat{x} \in \mathbb{R}$ stetig, denn für jede beliebige Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gilt

$$\lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} c = c.$$

2. Die identische Funktion $id : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, die durch $id(x) = x$ definiert ist, ist in jedem Punkt $\hat{x} \in \mathbb{R}$ stetig, denn wenn $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Folge ist, so dass

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = \hat{x}$$

gilt, dann folgt sofort

$$\lim_{n \rightarrow \infty} id(x_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} x_n = \hat{x}.$$

3. Die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, die durch $f(x) = x^2$ definiert ist, ist in jedem Punkt stetig, denn falls $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Folge ist, so dass

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = \hat{x}$$

gilt, dann folgt nach dem Satz über den Grenzwert einer Folge von Produkten

$$\lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} x_n^2 = \left(\lim_{n \rightarrow \infty} x_n\right) \cdot \left(\lim_{n \rightarrow \infty} x_n\right) = \hat{x} \cdot \hat{x} = \hat{x}^2$$

4. Das letzte Beispiel läßt sich verallgemeinern: Die Funktionen $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ und $g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ seien im Punkt \hat{x} stetig. Dann ist auch die Funktion $h : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ die durch $h(x) := f(x) \cdot g(x)$ definiert ist, stetig. Denn sei $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Folge, die gegen \hat{x} konvergiert. Dann gilt

$$\begin{aligned} \lim_{n \rightarrow \infty} h(x_n) &= \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) \cdot g(x_n) && \text{Definition von } h \\ &= \left(\lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n)\right) \cdot \left(\lim_{n \rightarrow \infty} g(x_n)\right) && \text{Grenzwert von Produkten} \\ &= f\left(\lim_{n \rightarrow \infty} x_n\right) \cdot g\left(\lim_{n \rightarrow \infty} x_n\right) && f \text{ und } g \text{ sind stetig} \\ &= f(\hat{x}) \cdot g(\hat{x}) && \lim_{n \rightarrow \infty} x_n = \hat{x} \\ &= h(\hat{x}) && \text{Definition von } h \end{aligned}$$

5. Mit einer zum letzten Fall analogen Argumentation können wir leicht einsehen, dass alle Funktionen, die ausgehend von den konstanten Funktionen $x \mapsto c$ und der identischen Funktion $x \mapsto x$ mit Hilfe der elementaren Rechen-Operationen “+”, “−”, “·” und “/” gebildet werden können, stetig sind. Solche Funktionen werden als rationale Funktionen bezeichnet. Ein Beispiel für eine solche Funktion ist

$$x \mapsto \frac{x^3 - 2 \cdot x + 1}{x^2 - 1}.$$

Diese Funktion ist für alle $x \in \mathbb{R} \setminus \{1, -1\}$ definiert und ist nach der obigen Argumentation stetig.

6. Die Funktion $\text{sign} : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ sei durch

$$\text{sign}(x) = \begin{cases} +1 & \text{falls } x > 0, \\ 0 & \text{falls } x = 0, \\ -1 & \text{falls } x < 0. \end{cases}$$

definiert. Diese Funktion ist im Punkt 0 nicht stetig, denn für die Folge $(\frac{1}{n+1})_{n \in \mathbb{N}}$ gilt

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n+1} = 0, \quad \text{aber} \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \text{sign}\left(\frac{1}{n+1}\right) = \lim_{n \rightarrow \infty} 1 = 1 \neq 0 = \text{sign}(0).$$

Anschaulich ist die Funktion $\text{sign} : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ im Punkt 0 nicht stetig, weil sie an dieser Stelle einen Sprung hat.

Definition 36 (Uneigentliche Konvergenz) Wir sagen, dass eine Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegen Unendlich konvergiert und schreiben

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = \infty$$

wenn gilt:

$$\forall c \in \mathbb{R} : \exists K \in \mathbb{N} : \forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow x_n > c.$$

Beispiel: Für die Folge $(n)_{n \in \mathbb{N}}$ gilt offenbar

$$\lim_{n \rightarrow \infty} n = \infty.$$

Definition 37 Es sei $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ eine Funktion und $\lambda \in \mathbb{R}$. Gilt für jede Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = \infty \Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = \lambda$$

dann schreiben wir

$$\lim_{x \rightarrow \infty} f(x) = \lambda$$

Beispiel: Es gilt

$$\lim_{x \rightarrow \infty} \frac{1}{x} = 0.$$

Beweis: Es sei eine Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegeben, so dass

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = \infty$$

gilt. Nach Definition der uneigentlichen Konvergenz gegen ∞ gilt dann

$$\forall c \in \mathbb{R} : \exists K \in \mathbb{N} : \forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow x_n > c \quad (3.1)$$

Wir müssen zeigen, dass gilt:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{x_n} = 0.$$

Dies ist nach der Definition des Grenzwerts einer Folge äquivalent zu der Formel

$$\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \exists K \in \mathbb{N} : \forall n \in \mathbb{N} : n > K \rightarrow \left| \frac{1}{x_n} \right| < \varepsilon \quad (3.2)$$

Um diese Formel nachzuweisen, nehmen wir an, dass eine Zahl $\varepsilon > 0$ gegeben ist. Wir müssen dann ein K finden, so dass für alle natürlichen Zahlen n , die größer als K sind, die Ungleichung

$$\left| \frac{1}{x_n} \right| < \varepsilon$$

gilt. Dies gelingt uns mit Hilfe der Formel (3.1), denn wenn wir in dieser Formel $c := \frac{1}{\varepsilon}$ definieren,

dann finden wir eine Zahl K , so dass für alle natürlichen Zahlen n , die größer als K sind, die Ungleichung

$$x_n > c, \quad \text{also } x_n > \frac{1}{\varepsilon}$$

gilt. Invertieren wir nun diese Ungleichung, so folgt

$$\frac{1}{x_n} < \varepsilon$$

und da andererseits aus $x_n > \frac{1}{\varepsilon}$ und $\varepsilon > 0$ auch $x_n > 0$ und damit $\frac{1}{x_n} > 0$ folgt, haben wir insgesamt

$$\left| \frac{1}{x_n} \right| < \varepsilon$$

für alle $n > K$ gezeigt. □

Es gibt eine alternative Definition der Stetigkeit, die zur der oben gegebenen Definition äquivalent ist. Diese Definition trägt den Namen ε - δ -Definition der Stetigkeit. Wir formulieren die Äquivalenz dieser Definition mit der oben gegebenen Definition als Satz.

Satz 38 Eine Funktion $f : D \rightarrow \mathbb{R}$ ist genau dann stetig im Punkt \hat{x} , wenn gilt:

$$\forall \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \exists \delta \in \mathbb{R}_+ : \forall x \in \mathbb{R} : |x - \hat{x}| < \delta \rightarrow |f(x) - f(\hat{x})| < \varepsilon.$$

Definition 39 (Allgemeine Stetigkeit)

Eine Funktion $f : \mathbb{D} \rightarrow \mathbb{R}$ heißt *stetig* genau dann, wenn die Funktion f für alle $\hat{x} \in D$ stetig ist.

Aufgabe 12: Es sei $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$. Geben Sie eine sinnvolle Definition für

$$\lim_{x \rightarrow \infty} f(x) = \infty.$$

3.2 Bestimmung von Nullstellen

In der Praxis tritt häufig die Frage auf, ob eine Funktion in einem bestimmten Intervall eine Nullstelle hat. Zusätzlich werden Verfahren benötigt, mit denen eine solche Nullstelle gegebenenfalls berechnet werden kann.

Satz 40 (Zwischenwert-Satz) Die Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ sei stetig. Weiter sei $f(a) \leq 0$ und $f(b) \geq 0$. Dann gibt es ein $x_0 \in [a, b]$, so dass $f(x_0) = 0$ ist.

Beweis: Wir geben ein Verfahren an, mit dem eine Nullstelle berechnet werden kann und weisen dann nach, dass der von diesem Verfahren gelieferte Wert tatsächlich eine Nullstelle der Funktion ist. Das Verfahren, dass wir vorstellen werden, wird in der Literatur als *Verfahren der Intervall-Halbierung* oder auch als *Bisektions-Verfahren* bezeichnet. Das Verfahren folgt dem Prädigma “*Teile und Herrsche*”. Beim Bisektions-Verfahren definieren wir induktiv zwei Folgen $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$.

I.A.: $n = 0$.

$$a_0 := a, \quad b_0 := b.$$

I.S.: $n \mapsto n + 1$

Zunächst definieren wir c_n als das arithmetische Mittel von a_n und b_n :

$$c_n := \frac{1}{2} \cdot (a_n + b_n).$$

Dann definieren wir a_{n+1} und b_{n+1} simultan durch Fall-Unterscheidung:

$$\langle a_{n+1}, b_{n+1} \rangle := \begin{cases} \langle a_n, c_n \rangle & \text{falls } f(c_n) > 0 \\ \langle c_n, b_n \rangle & \text{falls } f(c_n) \leq 0. \end{cases}$$

Aus dieser Definition folgt sofort per Induktion, dass für alle $n \in \mathbb{N}$ gilt:

1. $f(a_n) \leq 0$.
2. $f(b_n) \geq 0$.
3. $a_n \leq a_{n+1}$, die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist also monoton steigend.
4. $b_n \geq b_{n+1}$, die Folge $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ist also monoton fallend.
5. $a_n \leq b_n$.
6. $b_n - a_n = \left(\frac{1}{2}\right)^n \cdot (b - a)$.

Wir führen hier nur den Nachweis der letzten Behauptung vor, denn diese Behauptung ist am wenigsten offensichtlich.

I.A.: $n = 0$. Es gilt

$$b_0 - a_0 = b - a = \left(\frac{1}{2}\right)^0 \cdot (b - a).$$

I.S.: $n \mapsto n + 1$.

Wir setzen $c_n := \frac{1}{2} \cdot (a_n + b_n)$ und führen eine Fall-Unterscheidung durch.

(a) $f(c_n) > 0$. Dann gilt $a_{n+1} = a_n$ und $b_{n+1} = c_n = \frac{1}{2} \cdot (a_n + b_n)$. Also haben wir

$$\begin{aligned} b_{n+1} - a_{n+1} &= \frac{1}{2} \cdot (a_n + b_n) - a_n \\ &= \frac{1}{2} \cdot (b_n - a_n) \\ &\stackrel{IV}{=} \frac{1}{2} \cdot \left(\frac{1}{2}\right)^n \cdot (b - a) \\ &= \left(\frac{1}{2}\right)^{n+1} \cdot (b - a) \end{aligned}$$

(b) $f(c_n) \leq 0$. Jetzt gilt $a_{n+1} = c_n = \frac{1}{2} \cdot (a_n + b_n)$ und $b_{n+1} = b_n$. Also haben wir

$$\begin{aligned} b_{n+1} - a_{n+1} &= b_n - \frac{1}{2} \cdot (a_n + b_n) \\ &= \frac{1}{2} \cdot (b_n - a_n) \\ &\stackrel{IV}{=} \frac{1}{2} \cdot \left(\frac{1}{2}\right)^n \cdot (b - a) \\ &= \left(\frac{1}{2}\right)^{n+1} \cdot (b - a) \end{aligned}$$

Damit ist die Behauptung in beiden Fällen bewiesen.

Aus den Behauptungen 3., 4., und 5. folgt, dass die Folge $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ durch a nach unten beschränkt ist, denn es gilt

$$a = a_0 \leq a_1 \leq \dots \leq a_{n-1} \leq a_n \leq b_n, \text{ also gilt } a \leq b_n \text{ für alle } n \in \mathbb{N}$$

Da die Folge $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ monoton fallend und nach unten beschränkt ist, muss diese Folge nach Satz 12 auch konvergent sein. Wir definieren

$$\hat{b} := \lim_{n \rightarrow \infty} b_n.$$

In analoger Weise sehen wir, dass die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ konvergent ist und definieren

$$\hat{a} := \lim_{n \rightarrow \infty} a_n.$$

Als nächstes weisen wir nach dass $\hat{a} = \hat{b}$ ist. Dazu betrachten wir die Differenz der Grenzwerte:

$$\begin{aligned} \hat{b} - \hat{a} &= \left(\lim_{n \rightarrow \infty} b_n \right) - \left(\lim_{n \rightarrow \infty} a_n \right) \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} b_n - a_n \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n \cdot (b - a) \\ &= (b - a) \cdot \lim_{n \rightarrow \infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n = 0. \end{aligned}$$

Da die Funktion f stetig ist, gilt

$$\lim_{n \rightarrow \infty} f(a_n) = f\left(\lim_{n \rightarrow \infty} a_n\right) = f(\hat{a}).$$

Wegen $\forall n \in \mathbb{N} : f(a_n) \leq 0$ folgt dann sofort

$$f(\hat{a}) \leq 0.$$

Genauso folgt aus der Stetigkeit von f , dass

$$\lim_{n \rightarrow \infty} f(b_n) = f\left(\lim_{n \rightarrow \infty} b_n\right) = f(\hat{b})$$

gilt. Aus $\forall n \in \mathbb{N} : f(b_n) \geq 0$ folgt dann sofort

$$f(\hat{b}) \geq 0.$$

Da $\hat{a} = \hat{b}$ gilt, haben wir natürlich auch $f(\hat{a}) = f(\hat{b})$. Dann haben wir aber sowohl

$$f(\hat{a}) \leq 0 \quad \text{als auch} \quad f(\hat{a}) = f(\hat{b}) \geq 0$$

und das funktioniert nur, wenn $f(\hat{a}) = 0$ ist. Damit haben wir eine Nullstelle von f in dem Intervall $[a, b]$ gefunden. \square

```

1  findZero := procedure(f, a, b, digits) {
2      assert(a < b, "a has to be less than b");
3      assert(f(a) * f(b) <= 0, "no sign change in interval [\$a$, \$b$]");
4      [ fa, fb ] := [ f(a), f(b) ];
5      while (b - a > (1/10)**(digits+1)) {
6          c := 1/2 * (a + b);
7          fc := f(c);
8          if ((fa < 0 && fc < 0.0) || (fa >= 0 && fc >= 0)) {
9              a := c; fa := fc;
10         } else {
11             b := c; fb := fc;
12         }
13     }
14     return 1/2 * (a + b);
15 };
16
17 root3 := procedure(x) {
18     return x * x * x - 2;
19 };
20
21 r3 := findZero(root3, 1, 2, 40);

```

Abbildung 3.1: Implementierung des Bisektions-Verfahrens in SETLX.

Das im Beweis des letzten Satzes beschriebene Intervall-Halbierungs-Verfahren läßt sich ohne große Mühe implementieren. Abbildung 3.1 zeigt eine solche Implementierung in der Sprache SETLX. Wir haben bei dieser Implementierung sorgsam darauf geachtet, dass die Funktion nicht an der selben Stelle mehrfach berechnet wird. Wenn wir dieses Verfahren einsetzen wollen um in einem vorgegeben Intervall nach einer Nullstelle zu suchen, so können wir im voraus berechnen, wieviele Iterationen zur Erzielung einer geforderten Genauigkeit benötigt werden: Soll die Nullstelle mit einer Genauigkeit von ε bestimmt werden, so muß die Zahl n der Iterationen so gewählt werden, dass

$$\left(\frac{1}{2}\right)^n \cdot (b - a) \leq \varepsilon$$

gilt. Um n zu bestimmen, logarithmieren wir diese Ungleichung und erhalten:

$$\begin{aligned}
& n \cdot \ln\left(\frac{1}{2}\right) + \ln(b-a) \leq \ln(\varepsilon) \\
\Leftrightarrow & n \cdot \ln\left(\frac{1}{2}\right) \leq \ln(\varepsilon) - \ln(b-a) \\
\Leftrightarrow & n \cdot \ln\left(\frac{1}{2}\right) \leq \ln\left(\frac{\varepsilon}{b-a}\right) \\
\Leftrightarrow & -n \cdot \ln(2) \leq \ln\left(\frac{\varepsilon}{b-a}\right) \\
\Leftrightarrow & n \geq -\frac{1}{\ln(2)} \cdot \ln\left(\frac{\varepsilon}{b-a}\right) \\
\Leftrightarrow & n \geq \frac{1}{\ln(2)} \cdot \ln\left(\frac{b-a}{\varepsilon}\right)
\end{aligned}$$

Wollen wir beispielsweise die Nullstelle der Funktion $x \mapsto x - \cos(x)$ im Intervall $[0, 1]$ auf eine Genauigkeit von $\varepsilon = 10^{-9}$ bestimmen, so finden wir

$$n \geq \frac{\ln(10^9)}{\ln(2)} = 9 \cdot \frac{\ln(10)}{\ln(2)} \approx 29.89735286,$$

Damit ist klar, dass wir 30 Iterationen des Verfahrens benötigen um die geforderte Genauigkeit zu erreichen. Tabelle 3.1 zeigt die Werte, die a_n und b_n bei der Lösung der Gleichung $x - \cos(x) = 0$ beim Intervall-Halbierungs-Verfahren annehmen. Nach 30 Iterationen weichen die Intervall-Grenzen a_n und b_n um weniger als 10^{-9} voneinander ab.

3.2.1 Die Regula Falsi

Beim Bisektions-Verfahren wird das Intervall in jedem Schritt in zwei gleich große Teile zerteilt, denn wir bestimmen den Mittelpunkt des Intervalls $[a, b]$ nach der Formel

$$c = \frac{1}{2} \cdot (a + b).$$

Bei dieser Formel werden die Beträge der Funktionswerte von f an den Stellen a und b überhaupt nicht berücksichtigt. Es liegt nahe, die Beträge der Funktionswerte in die Formel mit einfließen zu lassen, denn wenn beispielsweise $|f(a)|$ wesentlich kleiner $|f(b)|$ ist, dann ist zu vermuten, dass die Nullstelle von f näher an a als an b liegt.

Betrachten wir beispielsweise die Tabelle 3.1 so sehen wir, dass in dem 24-ten Iterations-Schritt die Funktion $x \mapsto x - \cos(x)$ an der rechten Intervall-Grenze b_n den Wert $\approx 7.7 \cdot 10^{-9}$ hat, während die Funktion an der linken Intervall-Grenze a_n den Wert $-9.2 \cdot 10^{-8}$ hat. Der Betrag dieses Wertes ist mehr als 10 mal so groß als der Wert an der rechten Intervall-Grenze. Folglich liegt es nahe zu vermuten, dass die Nullstelle näher an der rechten Intervall-Grenze liegt als an der linken. Die weitere Berechnung bestätigt diese Vermutung auch, denn die rechte Intervall-Grenze ändert sich bei den nächsten drei Iterationen nicht. Wie können wir diese Beobachtung ausnutzen? Anstatt in der Formel $c_n = \frac{1}{2} \cdot (a_n + b_n)$ die Punkte a und b unabhängig von den Funktionswerten gleich stark zu gewichten, könnten wir eine Intervall-Grenze dann stärker gewichten, wenn der Funktionswert dort kleiner ist, weil wir dann vermuten würden, dass dieser Punkt schon näher an der Nullstelle liegt. Eine naheliegende Idee ist daher, die Punkte a und b mit den Beträgen der reziproken Funktionswerten zu gewichten, denn die werden um so größer, je kleiner der Funktionswert ist. Dieser Ansatz führt auf die Formel

$$c = \frac{\frac{1}{|f(a)|} \cdot a + \frac{1}{|f(b)|} \cdot b}{\frac{1}{|f(a)|} + \frac{1}{|f(b)|}} = \frac{|f(b)| \cdot a + |f(a)| \cdot b}{|f(a)| + |f(b)|}$$

Wir erhalten die selbe Formel, wenn wir c dadurch bestimmen, dass wir eine Gerade durch die Punkte $\langle a, f(a) \rangle$ und $\langle b, f(b) \rangle$ legen und c als den Punkt festsetzen, bei dem diese Gerade die x -Achse scheidet. Die Gleichung für eine Gerade $g(x)$ hat die Form

n	a_n	b_n	$f(a_n)$	$f(b_n)$
0:	0.000000000	1.000000000	-1.00000000e+00	4.59697694e-01
1:	0.500000000	1.000000000	-3.77582562e-01	4.59697694e-01
2:	0.500000000	0.750000000	-3.77582562e-01	1.83111311e-02
3:	0.625000000	0.750000000	-1.85963120e-01	1.83111311e-02
4:	0.687500000	0.750000000	-8.53349462e-02	1.83111311e-02
5:	0.718750000	0.750000000	-3.38793724e-02	1.83111311e-02
6:	0.734375000	0.750000000	-7.87472546e-03	1.83111311e-02
7:	0.734375000	0.742187500	-7.87472546e-03	5.19571174e-03
8:	0.738281250	0.742187500	-1.34514975e-03	5.19571174e-03
9:	0.738281250	0.740234375	-1.34514975e-03	1.92387278e-03
10:	0.738281250	0.739257813	-1.34514975e-03	2.89009147e-04
11:	0.738769531	0.739257813	-5.28158434e-04	2.89009147e-04
12:	0.739013672	0.739257813	-1.19596671e-04	2.89009147e-04
13:	0.739013672	0.739135742	-1.19596671e-04	8.47007314e-05
14:	0.739074707	0.739135742	-1.74493466e-05	8.47007314e-05
15:	0.739074707	0.739105225	-1.74493466e-05	3.36253482e-05
16:	0.739074707	0.739089966	-1.74493466e-05	8.08791474e-06
17:	0.739082336	0.739089966	-4.68073746e-06	8.08791474e-06
18:	0.739082336	0.739086151	-4.68073746e-06	1.70358327e-06
19:	0.739084244	0.739086151	-1.48857844e-06	1.70358327e-06
20:	0.739084244	0.739085197	-1.48857844e-06	1.07502077e-07
21:	0.739084721	0.739085197	-6.90538266e-07	1.07502077e-07
22:	0.739084959	0.739085197	-2.91518116e-07	1.07502077e-07
23:	0.739085078	0.739085197	-9.20080247e-08	1.07502077e-07
24:	0.739085078	0.739085138	-9.20080247e-08	7.74702466e-09
25:	0.739085108	0.739085138	-4.21305004e-08	7.74702466e-09
26:	0.739085123	0.739085138	-1.71917379e-08	7.74702466e-09
27:	0.739085130	0.739085138	-4.72235666e-09	7.74702466e-09
28:	0.739085130	0.739085134	-4.72235666e-09	1.51233399e-09
29:	0.739085132	0.739085134	-1.60501133e-09	1.51233399e-09
30:	0.739085133	0.739085134	-4.63386709e-11	1.51233399e-09

Tabelle 3.1: Die ersten 30 Schritte des Bisektions-Verfahrens zur Lösung von $x - \cos(x) = 0$.

$$g(x) = \alpha \cdot x + \beta.$$

Setzen wir hier für x den Wert a und für $g(x)$ den Wert $f(a)$ ein, so erhalten wir die Gleichung

$$f(a) = \alpha \cdot a + \beta. \quad (3.3)$$

Analog erhalten wir die Gleichung

$$f(b) = \alpha \cdot b + \beta \quad (3.4)$$

wenn wir für x den Wert b und für $g(x)$ den Wert $f(b)$ einsetzen. Subtrahieren wir die beiden Gleichungen voneinander, so verschwindet die Unbekannte β und wir haben

$$f(b) - f(a) = \alpha \cdot (b - a), \quad \text{also} \quad \alpha = \frac{f(b) - f(a)}{b - a}.$$

Setzen wir diesen Wert für α in die Gleichung 3.3 ein, so ergibt sich

$$f(a) = \frac{f(b) - f(a)}{b - a} \cdot a + \beta.$$

Wir lösen diese Gleichung nach β auf und erhalten

$$\beta = \frac{f(a) \cdot (b-a) - (f(b) - f(a)) \cdot a}{b-a} = \frac{f(a) \cdot b - f(b) \cdot a}{b-a}.$$

Wir bestimmen c aus der Forderung, dass $g(c) = 0$ ist, also

$$0 = \alpha \cdot c + \beta$$

$$\Leftrightarrow c = -\frac{\beta}{\alpha}$$

Setzen wir hier die eben berechneten Werte für α und β ein, so erhalten wir

$$c = -\frac{\frac{f(a) \cdot b - f(b) \cdot a}{b-a}}{\frac{f(b) - f(a)}{b-a}} = \frac{f(b) \cdot a - f(a) \cdot b}{f(b) - f(a)}$$

Falls nun $f(a) < 0$ und $f(b) > 0$ ist, gilt $-f(a) = |f(a)|$ und $f(b) = |f(b)|$. Setzen wir diese Werte in die obige Gleichung ein, so erhalten wir

$$c = \frac{|f(b)| \cdot a + |f(a)| \cdot b}{|f(a)| + |f(b)|}$$

und das ist die gleiche Formel, die wir auch oben schon abgeleitet hatten. Abbildung 3.2 zeigt die graphische Bestimmung von c als Schnittpunkt der Geraden mit der x -Achse.

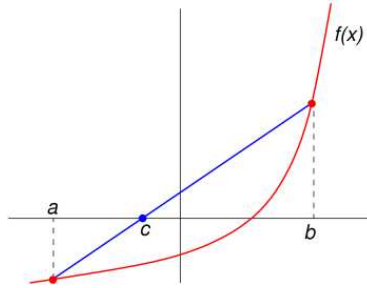


Abbildung 3.2: Die Regula-Falsi zur Nullstellen-Bestimmung.

Das Verfahren, dass mit dieser Formel arbeitet, ist unter dem Namen *Regula Falsi* bekannt und sieht genauso aus wie das Bisektions-Verfahren, nur dass wir für c jetzt die oben abgeleitete Formel verwenden:

I.A.: $n = 0$.

$$a_0 := a, \quad b_0 := b.$$

I.S.: $n \mapsto n + 1$

$$c_n := \frac{|f(b_n)| \cdot a_n + |f(a_n)| \cdot b_n}{|f(a_n)| + |f(b_n)|}.$$

Dann definieren wir a_{n+1} und b_{n+1} durch Fall-Unterscheidung:

$$\langle a_{n+1}, b_{n+1} \rangle := \begin{cases} \langle a_n, c_n \rangle & \text{falls } f(c_n) > 0 \\ \langle c_n, b_n \rangle & \text{falls } f(c_n) \leq 0. \end{cases}$$

Ähnlich wie beim Beweis des Zwischenwert-Satzes lässt sich zeigen, dass die Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ monoton steigend ist, während die Folge $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ monoton fallend ist. Da die Folgen überdies beschränkt sind, denn a_n ist immer kleiner als b und b_n ist immer größer als a , konvergieren beide Folgen. Allerdings ist nicht garantiert, dass a_n und b_n gegen den gleichen Grenzwert konvergieren! Es lässt sich lediglich zeigen, dass entweder a_n oder b_n gegen eine Nullstelle der Funktion f konvergiert. Um das Verfahren experimentell untersuchen zu können, implementieren wir es. Abbildung 3.3 zeigt die

Implementierung der Methode *findZero()*. Im Gegensatz zu der Implementierung des Bisektions-Verfahrens, in dem wir nur gefordert hatten, dass die Funktion einen Vorzeichen-Wechsel in dem Intervall $[a, b]$ hat, verlangen wir bei der Implementierung der Regula Falsi, dass

$$f(a) < 0 \quad \text{und} \quad f(b) > 0 \text{ ist.}$$

Diese Forderung ermöglicht eine etwas einfachere Implementierung.

Das letzte Argument der Methode *findZero()* gibt nun die gewünschte Zahl der Iterationen an. Dieses Argument ist erforderlich, denn die Methode selber liefert uns leider keinen Hinweis, wie gut die bisher berechnete Näherung ist. Das liegt daran, dass im allgemeinen die Folgen a_n und b_n nicht gegen den selben Grenzwert konvergieren.

Bei der Rückgabe des berechneten Wertes in Zeile 16 ist es erforderlich, die Beträge der Funktionswerte an den Intervall-Grenzen a_n und b_n zu vergleichen, denn wir wissen nicht, welche der beiden Folgen gegen die Nullstelle konvergiert. Wir geben daher als Ergebnis die Intervall-Grenze zurück, für die der Betrag des Funktionswertes am kleinsten ist. Da wir wissen, dass der Funktionswert an der linken Intervall-Grenze immer kleiner als 0 ist, erhalten wir dort den Betrag indem wir dem Funktionswert das Minuszeichen vorstellen.

```

1  regulaFalsi := procedure(f, a, b, n) {
2      assert(a < b, "Error: !(a < b)");
3      assert(f(a) < 0 && f(b) > 0, "Error: !(f(a) < 0 && f(b) > 0)");
4      count := 0;
5      fa := f(a); fb := f(b);
6      for (i in [1 .. n]) {
7          c := (fb * a - fa * b) / (fb - fa);
8          fc := f(c);
9          if (fc <= 0) {
10             a := c; fa := fc;
11         } else {
12             b := c; fb := fc;
13         }
14     }
15     if (-fa < fb) {
16         return a;
17     } else {
18         return b;
19     }
20 };

```

Abbildung 3.3: Implementierung der Regula Falsi in SETLX.

Tabelle 3.2 zeigt die ersten 12 Iterations-Schritte, wenn die Regula Falsi zur Berechnung der Nullstelle von $x - \cos(x)$ eingesetzt wird. Wir sehen, dass wir bereits im 9-ten Schritt die selbe Genauigkeit erreicht haben, für die wir mit dem Bisektions-Verfahren 30 Schritte benötigt haben. Wir sehen auch, dass die rechte Intervall-Grenze immer konstant bleibt. Es sieht so aus, als ob wir mit der Regula Falsi ein Verfahren haben, dass dem Bisektions-Verfahren überlegen ist. Die nächste Aufgabe zeigt Ihnen jedoch, dass dem Verfahren eine ganz wichtige Eigenschaft fehlt, die das Bisektions-Verfahren besitzt: Das Verfahren ist nicht robust! Es gibt Funktionen, bei denen die Regula Falsi zur Nullstellen-Bestimmung **wesentlich mehr** Iterationen benötigt als das Bisektions-Verfahren.

Aufgabe 13: Verwenden Sie die Regula Falsi zur Lösung der Gleichung

$$x^4 - 1 = 0.$$

n	a_n	b_n	$f(a_n)$	$f(b_n)$
1:	0.000000000	1.000000000	-1.00000000e+00	4.59697694e-01
2:	0.685073357	1.000000000	-8.92992765e-02	4.59697694e-01
3:	0.736298997	1.000000000	-4.66003904e-03	4.59697694e-01
4:	0.738945356	1.000000000	-2.33925666e-04	4.59697694e-01
5:	0.739078130	1.000000000	-1.17191742e-05	4.59697694e-01
6:	0.739084782	1.000000000	-5.87046549e-07	4.59697694e-01
7:	0.739085115	1.000000000	-2.94066726e-08	4.59697694e-01
8:	0.739085132	1.000000000	-1.47305551e-09	4.59697694e-01
9:	0.739085133	1.000000000	-7.37890543e-11	4.59697694e-01
10:	0.739085133	1.000000000	-3.69623245e-12	4.59697694e-01
11:	0.739085133	1.000000000	-1.85199566e-13	4.59697694e-01
12:	0.739085133	1.000000000	-9.23913723e-15	4.59697694e-01

Tabelle 3.2: Die ersten 12 Schritte der Regula Falsi zur Lösung von $x - \cos(x) = 0$.

Starten Sie mit dem Intervall $[0, 10]$. Zeigen Sie, dass für alle natürlichen Zahlen n mit $n \leq 1000$ die folgende Ungleichung für die linke Intervall-Grenze a_n gilt:

$$a_n \leq \frac{n}{1000}.$$

Die Lösung der Gleichung $x^4 - 1 = 0$ in dem Intervall ist $x = 1$. Aus der zu zeigenden Ungleichung kann beispielsweise gefolgert werden, dass $a_{100} \leq 0.1$ gilt. Der mit dem obigen Programm ermittelte Wert für a_{100} ist $a_{100} = 0.0985146583$. In diesem Fall hat die Regula Falsi also selbst nach 100 Iterationen nicht eine einzige korrekte Stelle im Ergebnis berechnen können!

Lösung: Wir zeigen durch vollständige Induktion über n , dass für alle $n \leq 1000$ zum einen die Ungleichung $a_n \leq n \cdot 10^{-3}$ gilt und dass zum anderen b_n konstant ist, es gilt $b_n = 10$.

I.A.: $n = 0$. Es gilt

$$a_0 = 0 \leq 0 \cdot 10^{-3} \quad \text{und} \quad b_0 = 10.$$

I.S.: $n \mapsto n + 1$.

Die Funktion $f := (x \mapsto x^4 - 1)$ ist für nichtnegative Zahlen monoton steigend, dass heißt aus $0 \leq u \leq v$ folgt auch $f(u) \leq f(v)$. Es gilt

$$f(n \cdot 10^{-3}) = n^4 \cdot 10^{-12} - 1 \quad \text{und} \quad f(10) = 10^4 - 1.$$

Nach Induktions-Voraussetzung können wir a_n durch $n \cdot 10^{-3}$ abschätzen und aufgrund der Monotonie von f können wir dann $f(a_n)$ durch $f(n \cdot 10^{-3})$ abschätzen. Wenden wir daher für $a'_n = n \cdot 10^{-3}$ und $b_n = 10$ die Regula Falsi an um eine Näherung c'_n für die Nullstelle von f zu berechnen, so wird c'_n größer sein als der wahre Wert von c_n , der in dem Algorithmus tatsächlich auftritt. Es gilt:

$$\begin{aligned}
c'_n &= \frac{f(b_n) \cdot a'_n - f(a'_n) \cdot b_n}{f(b_n) - f(a'_n)} \\
&= \frac{f(10) \cdot n \cdot 10^{-3} + f(n \cdot 10^{-3}) \cdot 10}{f(10) - f(n \cdot 10^{-3})} \\
&= \frac{(10^4 - 1) \cdot n \cdot 10^{-3} - (n^4 \cdot 10^{-12} - 1) \cdot 10}{10^4 - 1 - n^4 \cdot 10^{-12} + 1} \\
&= 10^{-4} \cdot \frac{10 \cdot n - n \cdot 10^{-3} - n^4 \cdot 10^{-11} + 10}{1 - n^4 \cdot 10^{-16}} \\
&= 10^{-3} \cdot \frac{n + 1 - n \cdot 10^{-4} - n^4 \cdot 10^{-12}}{1 - n^4 \cdot 10^{-16}}
\end{aligned}$$

Wir untersuchen nun, für welche natürlichen Zahlen n die Ungleichung $c'_n \leq 10^{-3} \cdot (n + 1)$ gilt.

$$\begin{aligned}
&c'_n \leq 10^{-3} \cdot (n + 1) \\
\Leftrightarrow &10^{-3} \cdot \frac{n + 1 - n \cdot 10^{-4} - n^4 \cdot 10^{-12}}{1 - n^4 \cdot 10^{-16}} \leq 10^{-3} \cdot (n + 1) \\
\Leftrightarrow &n + 1 - n \cdot 10^{-4} - n^4 \cdot 10^{-12} \leq (n + 1) \cdot (1 - n^4 \cdot 10^{-16}) \\
\Leftrightarrow &n + 1 - n \cdot 10^{-4} - n^4 \cdot 10^{-12} \leq (n + 1) - (n + 1) \cdot n^4 \cdot 10^{-16} \\
\Leftrightarrow &-n \cdot 10^{-4} - n^4 \cdot 10^{-12} \leq -(n + 1) \cdot n^4 \cdot 10^{-16} \\
\Leftrightarrow &n \cdot 10^{-4} + n^4 \cdot 10^{-12} \geq (n + 1) \cdot n^4 \cdot 10^{-16} \\
\Leftrightarrow &n^4 \cdot 10^{-12} \geq (n + 1) \cdot n^4 \cdot 10^{-16} \\
\Leftrightarrow &1 \geq (n + 1) \cdot 10^{-4} \\
\Leftrightarrow &10^4 \geq n + 1 \\
\Leftrightarrow &n \leq 9999
\end{aligned}$$

Solange $n < 1000$ ist, gilt also sicher $c'_n < 1$ und damit ist $f(c'_n)$ negativ. Daher gilt

$$a_{n+1} \leq a'_{n+1} = c'_n \leq 10^{-3} \cdot n \text{ und } b_{n+1} = b_n = 1.$$

3.2.2 Das Sekanten-Verfahren

Ein Problem bei der Regula Falsi scheint darin zu liegen, dass häufig eine Intervall-Grenze während der gesamten Iteration fest bleibt. Dies war schon bei der Bestimmung der Nullstelle der Funktion $x \mapsto x - \cos(x)$ der Fall. Eine Möglichkeit, dieses Problem zu umgehen besteht darin, dass wir anstatt eine Folge von Intervallen $([a_n, b_n])_{n \in \mathbb{N}}$ zu bilden einfach nur eine Folge von Punkten $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ bilden. Den Punkt x_{n+1} bestimmen wir, indem wir durch die Punkte x_{n+1} und x_n eine Gerade legen und dann x_n als den Schnittpunkt dieser Geraden mit der x -Achse bestimmen. Das führt auf die selbe Formel wie bei der Regula-Falsi, wir setzen nämlich

$$x_{n+1} := \frac{f(x_n) \cdot x_{n-1} - f(x_{n-1}) \cdot x_n}{f(x_n) - f(x_{n-1})}.$$

Dann brauchen wir nur noch zwei Startwerte x_0 und x_1 und die Rechnung kann los gehen. Abbildung 3.4 zeigt eine Implementierung des Sekanten-Verfahrens in SETLX. Testen wir dieses Programm mit der Funktion $x \mapsto x - \cos(x)$, so erhalten wir die in Tabelle 3.3 gezeigten Werte. Wir sehen, dass jetzt bereits 7 Iterationen ausreichen, um die Lösung der Gleichung mit der geforderten Genauigkeit zu berechnen. Es sieht also so aus, als ob das Sekanten-Verfahren den anderen

Verfahren überlegen ist. In der Tat kann gezeigt werden, dass das Sekanten-Verfahren, **wenn** es denn konvergiert, schneller konvergiert als die anderen Verfahren. Wir werden das später präzisieren. Das Problem ist, dass das Sekanten-Verfahren gar nicht immer konvergiert. Betrachten wir beispielsweise die Funktion

$$x \mapsto \frac{2}{x^2 + 1} - 1.$$

Diese Funktion hat bei $x = 1.0$ eine Nullstelle. Mit den Startwerten $a = 0$ und $b = 5.0$ produziert unser Programm die in Tabelle 3.4 gezeigten Werte.

```

1  secant := procedure(f, a, b, digits) {
2      fa := f(a);
3      fb := f(b);
4      while (abs(b - a) > (1/10)**(digits + 1)) {
5          c := (fb * a - fa * b) / (fb - fa);
6          a := b; b := c; fa := fb; fb := f(c);
7      }
8      return b;
9  };

```

Abbildung 3.4: Implementierung des Sekanten-Verfahrens in SETLX.

n	x_n	$f(x_n)$
1:	10.0000000000	+1.08390715e+01
2:	0.84466083134	+1.80675899e-01
3:	0.68946400911	-8.21230732e-02
4:	0.73796206792	-1.87910933e-03
5:	0.73909776898	+2.11474296e-05
6:	0.73908513008	-5.24715686e-09
7:	0.73908513322	-1.46275678e-14

Tabelle 3.3: Lösung der Gleichung $x - \cos(x) = 0$ mit dem Sekanten-Verfahren.

n	x_n	$f(x_n)$
1:	+5.000000e+00	-0.923076923
2:	+2.600000e+00	-0.742268041
3:	-7.252631e+00	-0.962687030
4:	+3.577905e+01	-0.998438891
5:	-1.165962e+03	-0.999998529
6:	+7.693592e+05	-1.000000000
7:	-5.237534e+11	-1.000000000
8:	+1.550094e+23	-1.000000000
9:	∞	-1.000000000

Tabelle 3.4: Divergenz des Sekanten-Verfahrens bei der Lösung von $\frac{2}{x^2 + 1} - 1 = 0$.

3.2.3 Das Illinois-Verfahren

Von den bisher vorgestellten Verfahren ist nur das Bisektions-Verfahren wirklich robust. Bei der Regula-Falsi ist das Problem, dass eine Intervall-Grenze stehen bleiben kann. Am Beispiel der Funktion $x \mapsto x^4 - 1$ haben wir gesehen, dass dies zu einer sehr langsamen Konvergenz führen kann. Beim Sekanten-Verfahren hatten wir dieses Problem behoben, aber dort kann es in ungünstigen Fällen passieren, dass das Verfahren überhaupt nicht konvergiert. Das *Illinois-Verfahren* [6] versucht die Konvergenz der Regula Falsi auf andere Weise zu beschleunigen. Die Idee des Verfahrens ist eigentlich sehr naheliegend: Wenn bei der Regula Falsi eine der Intervall-Grenzen über zwei oder mehr Schritte konstant bleibt, dann wird der Funktionswert an der betreffenden Intervall-Grenze halbiert, so dass der Einfluss dieses Wertes bei der Berechnung der nächsten Näherung c_n nach der Formel

$$c_n := \frac{f(b_n) \cdot a_n - f(a_n) \cdot b_n}{f(b_n) - f(a_n)}$$

gemindert wird. Nehmen wir o.B.d.A. an, dass $f(a) < 0$ und $0 < f(b)$ ist, so führt das zur folgenden Definition der Folgen $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$:

I.A.: $n = 0$. Wir setzen

$$a_0 := a, \quad b_0 := b, \quad \alpha_0 := 1, \quad \text{und} \quad \beta_0 := 1.$$

Die Werte α_n und β_n sind dabei Gewichtungsfaktoren, die wir später benötigen.

I.S.: $n \mapsto n + 1$. Wir definieren ähnlich wie bei der Regula Falsi den Wert c_n als

$$c_n := \frac{\beta_n \cdot f(b_n) \cdot a_n - \alpha_n \cdot f(a_n) \cdot b_n}{\beta_n \cdot f(b_n) - \alpha_n \cdot f(a_n)}.$$

Der Unterschied zur Regula Falsi liegt in den Gewichtungsfaktoren α_n und β_n . Die Werte für a_{n+1} und b_{n+1} werden durch die selbe Fall-Unterscheidung wie bei der Regula Falsi festgelegt:

$$\langle a_{n+1}, b_{n+1} \rangle := \begin{cases} \langle a_n, c_n \rangle & \text{falls } f(c_n) > 0 \\ \langle c_n, b_n \rangle & \text{falls } f(c_n) \leq 0. \end{cases}$$

Falls wir nun feststellen, dass $b_{n+1} = b_n$ gilt, so hat sich der Wert der rechten Intervall-Grenze nicht geändert. Wir wollen diesen Wert daher beim nächsten Iterations-Schritt schwächer gewichten und setzen deshalb in diesem Fall

$$\beta_{n+1} = \frac{1}{2} \cdot \beta_n \quad \text{und} \quad \alpha_{n+1} := 1.$$

Ist umgekehrt $a_{n+1} = a_n$, so hat sich der Wert der linken Intervall-Grenze nicht geändert. Wir gewichten daher die linke Intervall-Grenze beim nächsten Iterations-Schritt schwächer und setzen

$$\beta_{n+1} = 1 \quad \text{und} \quad \alpha_{n+1} := \frac{1}{2} \cdot \alpha_n.$$

Die Umsetzung dieses Verfahrens sehen Sie in Abbildung 3.5.

```

1  illinois := procedure(f, a, b, n) {
2      assert(a < b, "a has to be less than b");
3      [ fa, fb ] := [ f(a), f(b) ];
4      assert(fa < 0 && 0 < fb, "We need f(a) < 0 and 0 < f(b)!");
5      k := 1;
6      [ oldA, oldB ] := [ a, b ];
7      while (k <= n) {
8          c := (fb * a - fa * b) / (fb - fa);
9          fc := f(c);
10         alpha := 1; beta := 1;
11         if (fc < 0) {
12             a := c; fa := fc; alpha := 1;
13             if (oldB == b) {
14                 fb /= 2;
15                 beta /= 2;
16             }
17         } else if (fc > 0) {
18             b := c; fb := fc; beta := 1;
19             if (oldA == a) {
20                 fa /= 2;
21                 alpha /= 2;
22             }
23         } else {
24             return c;
25         }
26         [ oldA, oldB ] := [ a, b ];
27         if (isRational(a) && isRational(b)) {
28             print("$k$: a = $nDecimalPlaces(a, 41)$, b = $nDecimalPlaces(b, 41)$");
29         } else {
30             print("$k$: a = $a$, b = $b$, alpha = $alpha$, beta = $beta$");
31         }
32         k += 1;
33     }
34     return (a + b) / 2;
35 };

```

Abbildung 3.5: Implementierung des Illinois-Verfahrens zur Berechnung von Nullstellen.

3.3 Differenzierbare Funktionen

Definition 41 (Ableitung) Eine Funktion $f : D \rightarrow \mathbb{R}$ ist im Punkt $\hat{x} \in D$ *differenzierbar*, wenn der Grenzwert

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

existiert. In diesem Fall definieren wir

$$\frac{df}{dx}(\hat{x}) = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(\hat{x} + h) - f(\hat{x})}{h}.$$

Wir bezeichnen den Wert $\frac{df}{dx}(\hat{x})$ als die *Ableitung* der Funktion f an der Stelle \hat{x} . Gelegentlich werden wir auch die Schreibweise $f'(\hat{x})$ für die Ableitung verwenden.

Bemerkung: Beachten Sie, dass wir in der obigen Definition den Ausdruck

$$\frac{f(\hat{x} + h) - f(\hat{x})}{h}$$

als Funktion von h auffassen. Dieser Ausdruck wird auch als *Differenzial-Quotient* bezeichnet. Er gibt die Steigung einer Sekante an, die die Funktion $x \mapsto f(x)$ in den Punkten \hat{x} und $\hat{x} + h$ schneidet. Definieren wir

$$r(h) := f(\hat{x} + h) - f(\hat{x}) - h \cdot \frac{d}{dx}f(\hat{x}),$$

so gilt einerseits

$$\lim_{h \rightarrow 0} \frac{r(h)}{h} = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(\hat{x} + h) - f(\hat{x})}{h} - \frac{d}{dx}f(\hat{x}) = \frac{d}{dx}f(\hat{x}) - \frac{d}{dx}f(\hat{x}) = 0,$$

und andererseits haben wir

$$f(\hat{x} + h) = f(\hat{x}) + h \cdot \frac{d}{dx}f(\hat{x}) + r(h).$$

Die Funktion $r(h)$ ist also der Fehler, der bei der linearen Approximation entsteht.

Bemerkung: Falls die Funktion f im Punkt \hat{x} differenzierbar ist, dann ist die Funktion dort auch stetig, denn es gilt

$$\begin{aligned} \lim_{h \rightarrow 0} f(\hat{x} + h) &= \lim_{h \rightarrow 0} f(\hat{x} + h) - f(\hat{x}) + f(\hat{x}) \\ &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(\hat{x} + h) - f(\hat{x})}{h} \cdot h + f(\hat{x}) \\ &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(\hat{x} + h) - f(\hat{x})}{h} \cdot \lim_{h \rightarrow 0} h + f(\hat{x}) \\ &= f'(\hat{x}) \cdot 0 + f(\hat{x}) \\ &= f(\hat{x}) \end{aligned}$$

und $\lim_{h \rightarrow 0} f(\hat{x} + h) = f(\hat{x})$ heißt gerade, dass f im Punkt \hat{x} stetig ist.

Beispiele:

1. Die konstante Funktion $f := (x \mapsto c)$ hat überall die Ableitung 0, denn es gilt

$$\lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(\hat{x} + h) - f(\hat{x})}{h} = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{c - c}{h} = \lim_{h \rightarrow 0} 0 = 0.$$

2. Die identische Funktion $id := (x \mapsto x)$ hat überall die Ableitung 1, denn es gilt:

$$\lim_{h \rightarrow 0} \frac{id(\hat{x} + h) - id(\hat{x})}{h} = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{\hat{x} + h - \hat{x}}{h} = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{h}{h} = \lim_{h \rightarrow 0} 1 = 1.$$

3. Die Funktion $abs := (x \mapsto |x|)$, die den Absolutbetrag berechnet, ist im Punkte $\hat{x} = 0$ nicht differenzierbar. Wir zeigen, dass der Grenzwert

$$\lim_{h \rightarrow 0} \frac{abs(h) - abs(0)}{h}$$

nicht existiert. Dazu betrachten wir zunächst die Folge $(\frac{1}{n})_{n \in \mathbb{N}}$. Nehmen wir an, dass dieser Grenzwert existiert und den Wert a hat. Da

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} = 0$$

ist, müßte nach Definition des Grenzwerts dann gelten:

$$a = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{abs(h) - abs(0)}{h} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{abs(\frac{1}{n})}{\frac{1}{n}} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{\frac{1}{n}}{\frac{1}{n}} = 1.$$

Betrachten wir andererseits die Folge $(-\frac{1}{n})_{n \in \mathbb{N}}$ und berücksichtigen, dass diese Folge ebenfalls gegen 0 konvergiert, so erhalten wir

$$a = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{abs(h) - abs(0)}{h} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{abs(-\frac{1}{n})}{-\frac{1}{n}} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{\frac{1}{n}}{-\frac{1}{n}} = -1.$$

Da a nicht gleichzeitig die Werte $+1$ und -1 annehmen kann, müssen wir folgern, dass die Funktion abs an der Stelle $\hat{x} = 0$ nicht differenzierbar ist.

Satz 42 (Ableitungs-Regeln) Es seien $f : D \rightarrow \mathbb{R}$ und $g : D \rightarrow \mathbb{R}$ Funktionen, die im Punkt \hat{x} differenzierbar sind. Dann gilt:

1. Die Funktion $f + g := (x \mapsto f(x) + g(x))$ ist im Punkt \hat{x} differenzierbar und es gilt:

$$(f + g)'(\hat{x}) = f'(\hat{x}) + g'(\hat{x}).$$

2. Die Funktion $f - g := (x \mapsto f(x) - g(x))$ ist im Punkt \hat{x} differenzierbar und es gilt:

$$(f - g)'(\hat{x}) = f'(\hat{x}) - g'(\hat{x}).$$

3. Die Funktion $f \cdot g := (x \mapsto f(x) \cdot g(x))$ ist im Punkt \hat{x} differenzierbar und es gilt die Produkt-Regel:

$$(f \cdot g)'(\hat{x}) = f'(\hat{x}) \cdot g(\hat{x}) + f(\hat{x}) \cdot g'(\hat{x}).$$

4. Ist $g(\hat{x}) \neq 0$, dann ist die Funktion $\frac{f}{g} := (x \mapsto \frac{f(x)}{g(x)})$ im Punkt \hat{x} differenzierbar und es gilt die Quotienten-Regel:

$$\left(\frac{f}{g}\right)'(\hat{x}) = \frac{f'(\hat{x}) \cdot g(\hat{x}) - f(\hat{x}) \cdot g'(\hat{x})}{g(\hat{x})^2}.$$

Beweis: Wir zeigen nur die Produkt-Regel. Es gilt:

$$\begin{aligned} & (f \cdot g)'(\hat{x}) \\ &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{(f \cdot g)(\hat{x} + h) - (f \cdot g)(\hat{x})}{h} \\ &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(\hat{x} + h) \cdot g(\hat{x} + h) - f(\hat{x}) \cdot g(\hat{x})}{h} \\ &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(\hat{x} + h) \cdot g(\hat{x} + h) - f(\hat{x}) \cdot g(\hat{x} + h)}{h} + \frac{f(\hat{x}) \cdot g(\hat{x} + h) - f(\hat{x}) \cdot g(\hat{x})}{h} \\ &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(\hat{x} + h) \cdot g(\hat{x} + h) - f(\hat{x}) \cdot g(\hat{x} + h)}{h} + \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(\hat{x}) \cdot g(\hat{x} + h) - f(\hat{x}) \cdot g(\hat{x})}{h} \\ &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(\hat{x} + h) - f(\hat{x})}{h} \cdot \lim_{h \rightarrow 0} g(\hat{x} + h) + \lim_{h \rightarrow 0} f(\hat{x}) \cdot \lim_{h \rightarrow 0} \frac{g(\hat{x} + h) - g(\hat{x})}{h} \\ &= f'(\hat{x}) \cdot g(\hat{x}) + f(\hat{x}) \cdot g'(\hat{x}) \end{aligned}$$

Dabei haben wir im letzten Schritt ausgenutzt, dass eine differenzierbare Funktion auch stetig ist. Daher gilt

$$\lim_{h \rightarrow 0} g(\hat{x} + h) = g(\hat{x}). \quad \square$$

Aufgabe 14: Zeigen Sie: Ist die Funktion g im Punkt \hat{x} differenzierbar und gilt $g(\hat{x}) \neq 0$, so ist auch die Funktion $\frac{1}{g} := \left(x \mapsto \frac{1}{g(x)}\right)$ im Punkt \hat{x} differenzierbar und es gilt

$$\left(\frac{1}{g}\right)'(\hat{x}) = -\frac{g'(\hat{x})}{g(\hat{x})^2}.$$

Folgern Sie aus diesem Ergebnis die Quotienten-Regel.

Satz 43 (Ketten-Regel) Die Funktionen $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ sei differenzierbar im Punkt $\hat{x} \in \mathbb{R}$ und die Funktion $g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ sei differenzierbar im Punkt $\hat{y} = f(\hat{x})$. Dann ist auch die Funktion $g \circ f := (x \mapsto g(f(x)))$ im Punkt \hat{x} differenzierbar und es gilt

$$(g \circ f)'(\hat{x}) = g'(f(\hat{x})) \cdot f'(\hat{x}).$$

Beweis: Aus der Differenzierbarkeit von f und g folgt, dass es Funktionen $r_1(h)$ und $r_2(h)$ gibt, so dass gilt:

1. $f(\hat{x} + h) = f(\hat{x}) + h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h)$ mit $\lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_1(h)}{h} = 0$,
2. $g(\hat{y} + h) = g(\hat{y}) + h \cdot g'(\hat{y}) + r_2(h)$ mit $\lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_2(h)}{h} = 0$.

Damit finden wir für den Differenzial-Quotienten der Funktion $g \circ f$ im Punkt \hat{x} :

$$\begin{aligned} & \frac{(g \circ f)(\hat{x} + h) - (g \circ f)(\hat{x})}{h} \\ &= \frac{g(f(\hat{x} + h)) - g(f(\hat{x}))}{h} \\ &= \frac{g(f(\hat{x}) + h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h)) - g(f(\hat{x}))}{h} \\ &= \frac{g(\hat{y} + h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h)) - g(\hat{y})}{h} \\ &= \frac{g(\hat{y}) + (h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h)) \cdot g'(\hat{y}) + r_2(h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h)) - g(\hat{y})}{h} \\ &= f'(\hat{x}) \cdot g'(\hat{y}) + \frac{r_1(h)}{h} \cdot g'(\hat{y}) + \frac{r_2(h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h))}{h} \end{aligned}$$

Wenn wir jetzt den Grenzwert $h \rightarrow 0$ berechnen, dann müssen wir uns den letzten Term genauer ansehen. Es gilt

$$\begin{aligned} \lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_2(h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h))}{h} &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_2(h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h))}{h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h)} \cdot \frac{h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h)}{h} \\ &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_2(h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h))}{h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h)} \cdot \lim_{h \rightarrow 0} \frac{h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h)}{h} \\ &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_2(h)}{h} \cdot \left(\lim_{h \rightarrow 0} f'(\hat{x}) + \frac{r_1(h)}{h} \right) \\ &= 0 \cdot (f'(\hat{x}) + 0) \\ &= 0 \end{aligned}$$

Damit sehen wir:

$$\begin{aligned}
& \lim_{h \rightarrow 0} \frac{(g \circ f)(\hat{x} + h) - (g \circ f)(\hat{x})}{h} \\
&= \lim_{h \rightarrow 0} f'(\hat{x}) \cdot g'(\hat{y}) + \frac{r_1(h)}{h} \cdot g'(\hat{y}) + \frac{r_2(h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h))}{h} \\
&= f'(\hat{x}) \cdot g'(\hat{y}) + \lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_1(h)}{h} \cdot g'(\hat{y}) + \lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_2(h \cdot f'(\hat{x}) + r_1(h))}{h} \\
&= f'(\hat{x}) \cdot g'(\hat{y}) + 0 + 0 \\
&= f'(\hat{x}) \cdot g'(\hat{y}).
\end{aligned}$$

Der obige exakte Beweis ist recht umständlich. Wir geben daher zusätzlich eine Plausibilitätsbetrachtung. Nach Definition der Ableitung gilt

$$g'(\hat{y}) = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{g(\hat{y} + h) - g(\hat{y})}{h}$$

Für kleine Werte von h gilt daher ungefähr

$$g(\hat{y} + h) \approx g(\hat{y}) + g'(\hat{y}) \cdot h.$$

Analog finden wir für die Funktion f

$$f(\hat{x} + h) \approx f(\hat{x}) + f'(\hat{x}) \cdot h.$$

Damit finden wir für den Differenzial-Quotienten der Funktion $g \circ f$ im Punkt \hat{x} :

$$\begin{aligned}
\frac{(g \circ f)(\hat{x} + h) - (g \circ f)(\hat{x})}{h} &= \frac{g(f(\hat{x} + h)) - g(f(\hat{x}))}{h} \\
&\approx \frac{g(f(\hat{x}) + f'(\hat{x}) \cdot h) - g(f(\hat{x}))}{h} \\
&\approx \frac{g(f(\hat{x})) + g'(f(\hat{x})) \cdot f'(\hat{x}) \cdot h - g(f(\hat{x}))}{h} \\
&= \frac{g'(f(\hat{x})) \cdot f'(\hat{x}) \cdot h}{h} \\
&= g'(f(\hat{x})) \cdot f'(\hat{x})
\end{aligned}$$

Die linke Seite der Gleichung stellt den Differenzial-Quotienten der Funktion $g \circ f$ dar und muß daher für $h \rightarrow 0$ gegen die Ableitung $(g \circ f)(\hat{x})$ konvergieren. \square

Aufgabe 15: Zeigen Sie, dass für alle natürlichen Zahlen n gilt:

$$\frac{d x^n}{d x} = n \cdot x^{n-1}.$$

Satz 44 (Ableitung von Potenzreihen) Ist die Funktion f als Potenzreihe definiert,

$$\sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot x^n$$

und ist R der Konvergenz-Radius dieser Potenzreihe, so ist f für alle $x \in \mathbb{R}$ mit $|x| < R$ differenzierbar und es gilt

$$f'(x) = \sum_{n=1}^{\infty} n \cdot a_n \cdot x^{n-1}.$$

Der letzte Satz besagt, dass Potenzreihen innerhalb ihres Konvergenz-Radius gliedweise differenziert werden können. Ein Beweis dieses Satzes ist mit den uns zur Verfügung stehenden Hilfsmitteln nicht möglich.

Wir berechnen als nächstes die Ableitung einiger wichtiger Funktionen.

1. Die Exponential-Funktion $\exp(x)$ ist definiert als

$$\exp(x) = \sum_{n=0}^{\infty} \frac{x^n}{n!}.$$

Nach dem letzten Satz gilt für die Ableitung der Exponential-Funktion

$$\frac{d}{dx} \exp(x) = \sum_{n=1}^{\infty} \frac{n}{n!} \cdot x^{n-1} = \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{(n-1)!} \cdot x^{n-1} = \sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{n!} \cdot x^n = \exp(x),$$

die Ableitung der Exponential-Funktion ergibt also wieder die Exponential-Funktion!

2. Um den natürlichen Logarithmus ableiten zu können, betrachten wir die Gleichung

$$\ln(\exp(x)) = x.$$

Differenzieren wir beide Seiten dieser Gleichung nach x , so erhalten wir nach der Ketten-Regel

$$\ln'(\exp(x)) \cdot \exp(x) = 1,$$

denn die Ableitung der Exponential-Funktion ergibt ja wieder die Exponential-Funktion. Setzen wir hier $y := \exp(x)$, so haben wir

$$\ln'(y) \cdot y = 1, \quad \text{also} \quad \frac{d}{dy} \ln(y) = \frac{1}{y}.$$

3. Um die Ableitung der Funktion $x \mapsto \sin(x)$ berechnen zu können, betrachten wir die Definition von Sinus und Tangens am Einheitskreis: Aus der Definition von Sinus und Tangens folgt die Ungleichung

$$\sin(\varphi) \leq \varphi \leq \tan(\varphi) = \frac{\sin(\varphi)}{\cos(\varphi)}$$

Division dieser Gleichung durch $\sin(\varphi)$ liefert

$$1 \leq \frac{\varphi}{\sin(\varphi)} \leq \frac{1}{\cos(\varphi)}$$

Wir bilden den Kehrwert und erhalten

$$1 \geq \frac{\sin(\varphi)}{\varphi} \geq \cos(\varphi)$$

Nun bilden wir den Grenzwert für $\varphi \rightarrow 0$:

$$1 \geq \lim_{\varphi \rightarrow 0} \frac{\sin(\varphi)}{\varphi} \geq \lim_{\varphi \rightarrow 0} \cos(\varphi)$$

Wegen $\lim_{\varphi \rightarrow 0} \cos(\varphi) = \cos(0) = 1$ folgt daraus

$$\lim_{\varphi \rightarrow 0} \frac{\sin(\varphi)}{\varphi} = 1$$

Aus dem Geometrie-Unterricht ist das Additionstheorem für den Sinus bekannt:

$$\sin(x + y) = \sin(x) \cdot \cos(y) + \cos(x) \cdot \sin(y).$$

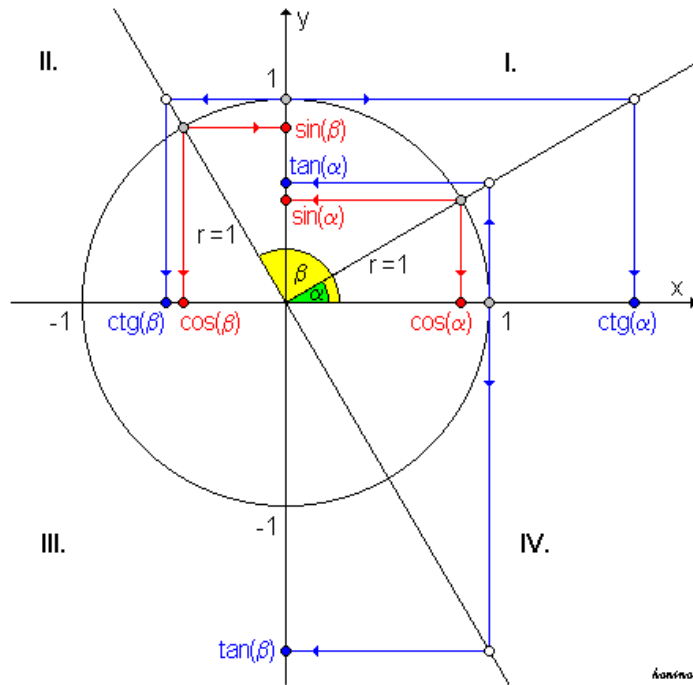


Abbildung 3.6: Die Winkel-Funktionen am Einheitskreis.

Daraus folgt einerseits

$$\begin{aligned}\sin(x) &= \sin\left(\frac{x+y}{2} + \frac{x-y}{2}\right) \\ &= \sin\left(\frac{x+y}{2}\right) \cdot \cos\left(\frac{x-y}{2}\right) + \cos\left(\frac{x+y}{2}\right) \cdot \sin\left(\frac{x-y}{2}\right)\end{aligned}$$

und andererseits gilt wegen $\sin(-x) = -\sin(x)$ und $\cos(-x) = \cos(x)$

$$\begin{aligned}\sin(y) &= \sin\left(\frac{x+y}{2} - \frac{x-y}{2}\right) \\ &= \sin\left(\frac{x+y}{2}\right) \cdot \cos\left(\frac{x-y}{2}\right) - \cos\left(\frac{x+y}{2}\right) \cdot \sin\left(\frac{x-y}{2}\right).\end{aligned}$$

Subtrahieren wir diese Gleichungen voneinander, so erhalten wir

$$\sin(x) - \sin(y) = 2 \cdot \cos\left(\frac{x+y}{2}\right) \cdot \sin\left(\frac{x-y}{2}\right).$$

Damit können wir die Ableitung des Sinus ausrechnen:

$$\begin{aligned}\lim_{h \rightarrow 0} \frac{\sin(x+h) - \sin(x)}{h} &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{2 \cdot \cos\left(\frac{x+h+x}{2}\right) \cdot \sin\left(\frac{x+h-x}{2}\right)}{h} \\ &= \lim_{h \rightarrow 0} \cos\left(x + \frac{h}{2}\right) \cdot \lim_{h \rightarrow 0} \frac{\sin\left(\frac{h}{2}\right)}{\frac{h}{2}} \\ &= \cos(x) \cdot \lim_{h \rightarrow 0} \frac{\sin(h)}{h} \\ &= \cos(x)\end{aligned}$$

Damit haben wir gezeigt, dass gilt:

$$\frac{d}{dx} \sin(x) = \cos(x).$$

4. Die Ableitung des Cosinus könnte in analoger Weise berechnet werden, es ist aber einfacher, wenn wir von den Gleichungen

$$\cos(x) = \sin\left(\frac{\pi}{2} - x\right) \quad \text{und} \quad \cos\left(\frac{\pi}{2} - x\right) = \sin(x)$$

ausgehen und die Ketten-Regel verwenden. Es ergibt sich

$$\begin{aligned} \frac{d}{dx} \cos(x) &= \frac{d}{dx} \sin\left(\frac{\pi}{2} - x\right) \\ &= \cos\left(\frac{\pi}{2} - x\right) \cdot \frac{d}{dx} \left(\frac{\pi}{2} - x\right) \quad \text{nach der Ketten-Regel} \\ &= \sin(x) \cdot (-1) \\ &= -\sin(x). \end{aligned}$$

5. Jetzt kann die Ableitung der Tangens-Funktion über die Quotienten-Regel berechnet werden:

$$\begin{aligned} \frac{d}{dx} \tan(x) &= \frac{d}{dx} \left(\frac{\sin(x)}{\cos(x)} \right) \\ &= \frac{\left(\frac{d}{dx} \sin(x) \right) \cdot \cos(x) - \sin(x) \cdot \left(\frac{d}{dx} \cos(x) \right)}{\cos^2(x)} \\ &= \frac{\cos(x) \cdot \cos(x) - \sin(x) \cdot (-\sin(x))}{\cos^2(x)} \\ &= \frac{\cos^2(x) + \sin^2(x)}{\cos^2(x)} \\ &= \frac{1}{\cos^2(x)} \end{aligned}$$

6. Die Ableitung der Arcus-Tangens-Funktion kann nun mit dem selben Trick berechnet werden, den wir schon bei der Berechnung der Ableitung des Logarithmus benutzt haben. Wir gehen diesmal von der Gleichungen

$$\arctan(\tan(x)) = x$$

aus und differenzieren beide Seiten dieser Gleichung. Nach der Ketten-Regel erhalten wir

$$\arctan'(\tan(x)) \cdot \frac{d}{dx} \tan(x) = 1.$$

Setzen wir hier die Ableitung für die Tangens-Funktion ein, so haben wir

$$\frac{d}{dx} \arctan(\tan(x)) \cdot \frac{1}{\cos^2(x)} = 1.$$

Multiplikation mit $\cos^2(x)$ ergibt

$$\frac{d}{dx} \arctan(\tan(x)) = \cos^2(x).$$

Den in dieser Gleichung auftretenden Term $\cos^2(x)$ müssen wir durch einen Term ausdrücken, in dem nur $\tan(x)$ auftritt. Dazu betrachten wir die Definition der Tangens-Funktion:

$$\begin{aligned}
\tan^2(x) &= \frac{\sin^2(x)}{\cos^2(x)} \\
\Leftrightarrow \tan^2(x) &= \frac{1 - \cos^2(x)}{\cos^2(x)} \quad \text{wegen } \sin^2(x) + \cos^2(x) = 1 \\
\Leftrightarrow \cos^2(x) \cdot \tan^2(x) &= 1 - \cos^2(x) \\
\Leftrightarrow \cos^2(x) \cdot \tan^2(x) + \cos^2(x) &= 1 \\
\Leftrightarrow \cos^2(x) \cdot (\tan^2(x) + 1) &= 1 \\
\Leftrightarrow \cos^2(x) &= \frac{1}{\tan^2(x) + 1}
\end{aligned}$$

Damit können wir also schreiben

$$\arctan'(\tan(x)) = \frac{1}{\tan^2(x) + 1}.$$

Setzen wir jetzt $y = \tan(x)$, so erhalten wir

$$\frac{d}{dy} \arctan(y) = \frac{1}{y^2 + 1}.$$

Aufgabe 16: Zeigen Sie

$$\frac{d}{dx} \arcsin(x) = \frac{1}{\sqrt{1-x^2}}.$$

Aufgabe 17: Berechnen Sie die Ableitung der Funktion $x \mapsto \sqrt{x}$.

Hinweis: Verwenden Sie die Produkt-Regel.

3.4 Mittelwert-Sätze

Definition 45 (lokales Maximum) Eine Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ hat im Punkt $\bar{x} \in \mathbb{R}$ ein *lokales Maximum*, wenn gilt:

$$\exists \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \forall x \in \mathbb{R} : |x - \bar{x}| < \varepsilon \rightarrow f(x) \leq f(\bar{x}).$$

Die in der obigen Definition auftretende Menge von Zahlen, deren Abstand von \bar{x} kleiner ist als ε , bezeichnen wir auch als ε -Umgebung des Punktes \bar{x} , die ε -Umgebung des Punktes x ist also die Menge

$$U_\varepsilon(\bar{x}) := \{x \in \mathbb{R} \mid |x - \bar{x}| < \varepsilon\}.$$

Der Begriff des lokalen Maximums steht im Kontrast zu dem Begriff eines *globalen Maximums*. Eine Funktion $f : D \rightarrow \mathbb{R}$ hat in einem Punkt $\bar{x} \in D$ ein globales Maximum, wenn

$$\forall x \in D : f(x) \leq f(\bar{x})$$

gilt. Natürlich ist jedes globale Maximum auch ein lokales Maximum, aber die Umkehrung gilt im allgemeinen nicht. Der nächste Satz liefert ein notwendiges Kriterium für das Auftreten eines lokalen Maximums.

Satz 46 (Pierre de Fermat, 1607–1665) Hat die Funktion $f : D \rightarrow \mathbb{R}$ im Punkt \bar{x} ein lokales Maximum, ist $U_\varepsilon(\bar{x}) \subseteq D$ und ist die Funktion f zusätzlich im Punkt \bar{x} differenzierbar, so gilt

$$\frac{d}{dx} f(\bar{x}) = 0.$$

Beweis: Wir betrachten zunächst die Folge $(\bar{x} + \frac{1}{n+1})_{n \in \mathbb{N}}$. O.B.d.A. sei ε so klein gewählt, dass

$$\forall x \in \mathbb{R} : |x - \bar{x}| < \varepsilon \rightarrow f(x) \leq f(\bar{x})$$

gilt. Wenn $n > \frac{1}{\varepsilon}$ liegt daher $\bar{x} + \frac{1}{n+1}$ in der ε -Umgebung von \bar{x} . Daher gilt für alle $n > \frac{1}{\varepsilon}$

$$f\left(\bar{x} + \frac{1}{n+1}\right) \leq f(\bar{x}).$$

Damit gilt für den Differenzial-Quotienten

$$\frac{f\left(\bar{x} + \frac{1}{n+1}\right) - f(\bar{x})}{\bar{x} + \frac{1}{n+1} - \bar{x}} = (n+1) \cdot \left(f\left(\bar{x} + \frac{1}{n+1}\right) - f(\bar{x})\right) \leq 0.$$

Da wir vorausgesetzt haben, dass die Funktion f im Punkt \bar{x} differenzierbar ist, gilt

$$\frac{d}{dx}f(\bar{x}) = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{f\left(\bar{x} + \frac{1}{n+1}\right) - f(\bar{x})}{\bar{x} + \frac{1}{n+1} - \bar{x}} \leq 0.$$

Wir betrachten nun die Folge $(\bar{x} - \frac{1}{n+1})_{n \in \mathbb{N}}$. Wieder sei ε so gewählt, dass

$$\forall x \in \mathbb{R} : |x - \bar{x}| < \varepsilon \rightarrow f(x) \leq f(\bar{x})$$

gilt. Wenn $n > \frac{1}{\varepsilon}$ liegt daher $\bar{x} - \frac{1}{n+1}$ in der ε -Umgebung von \bar{x} . Daher gilt für alle $n > \frac{1}{\varepsilon}$

$$f\left(\bar{x} - \frac{1}{n+1}\right) \leq f(\bar{x}).$$

Damit gilt für den Differenzial-Quotienten

$$\frac{f\left(\bar{x} - \frac{1}{n+1}\right) - f(\bar{x})}{\bar{x} - \frac{1}{n+1} - \bar{x}} = -(n+1) \cdot \left(f\left(\bar{x} - \frac{1}{n+1}\right) - f(\bar{x})\right) \geq 0.$$

Da wir vorausgesetzt haben, dass die Funktion f im Punkt \bar{x} differenzierbar ist, gilt

$$\frac{d}{dx}f(\bar{x}) = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{f\left(\bar{x} - \frac{1}{n+1}\right) - f(\bar{x})}{\bar{x} - \frac{1}{n+1} - \bar{x}} \geq 0.$$

Wir haben jetzt also die beiden Ungleichungen

$$\frac{d}{dx}f(\bar{x}) \leq 0 \quad \text{und} \quad \frac{d}{dx}f(\bar{x}) \geq 0$$

gezeigt. Daraus folgt sofort $\frac{d}{dx}f(\bar{x}) = 0$. □

Analog zur Definition eines lokalen Maximums kann auch der Begriff eines *lokalen Minimums* definiert werden. Auch in einem lokalen Minimum hat die Ableitung den Wert 0.

Satz 47 Ist die Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ stetig, so nimmt f auf dem Intervall $[a, b]$ sowohl das Maximum als auch das Minimum an, es gibt also Punkte x_{\min} und x_{\max} , so dass gilt

$$\forall x \in [a, b] : f(x) \leq f(x_{\max}) \quad \text{und} \quad \forall x \in [a, b] : f(x) \geq f(x_{\min}).$$

Aus Zeitgründen verzichten wir auf einen Beweis des letzten Satzes.

Satz 48 (Michel Rolle, 1652 – 1719) Ist die Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ differenzierbar und gilt

$f(a) = f(b)$, dann gibt es ein $\bar{x} \in (a, b)$, so dass gilt

$$\frac{d}{dx}f(\bar{x}) = 0.$$

Beweis: Es gibt zwei Fälle:

1. Die Funktion f ist konstant, für alle $x \in [a, b]$ gilt also $f(x) = f(a)$. Da die Ableitung einer konstanten Funktion den Wert 0 hat, gilt dann offenbar sogar für alle $x \in [a, b]$

$$\frac{d}{dx}f(x) = 0.$$

2. Da die Funktion f differenzierbar ist, ist sie auch stetig und nimmt daher sowohl ein Minimum als auch ein Maximum in dem Intervall $[a, b]$ an. Es gibt also x_{\min} und x_{\max} mit

$$\forall x \in [a, b] : f(x) \leq f(x_{\max}) \quad \text{und} \quad \forall x \in [a, b] : f(x) \geq f(x_{\min}).$$

Da wir jetzt voraussetzen können, dass die Funktion nicht konstant ist, und da weiterhin $f(a) = f(b)$ gilt, muss

$$f(x_{\min}) < f(a) \quad \text{oder} \quad f(x_{\max}) > f(a)$$

gelten. Daraus folgt

$$x_{\min} \notin \{a, b\} \quad \text{oder} \quad x_{\max} \notin \{a, b\}.$$

Damit hat die Funktion dann in x_{\min} ein lokales Minimum oder in x_{\max} ein lokales Maximum (oder beides) und nach dem Satz von Fermat folgt

$$\frac{d}{dx}f(x_{\min}) = 0 \quad \text{oder} \quad \frac{d}{dx}f(x_{\max}) = 0. \quad \square$$

Aus dem Satz von Rolle folgern wir später zwei wichtige Mittelwert-Sätze und den Satz von L'Hôpital (Guillaume François Antoine, Marquis de L'Hôpital, 1661–1704).

Satz 49 (Mittelwert-Satz der Differenzial-Rechnung, Augustin Louis Cauchy, 1789–1857)

Ist die Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ für alle $x \in [a, b]$ differenzierbar, so gilt:

$$\exists c \in (a, b) : \frac{d}{dx}f(c) = \frac{f(b) - f(a)}{b - a}.$$

Beweis: Wir definieren die Funktion $g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ durch

$$g(x) := f(x) - f(a) - \frac{f(b) - f(a)}{b - a} \cdot (x - a).$$

Die Funktion g ist offenbar differenzierbar und es gilt

$$g(a) = f(a) - f(a) - \frac{f(b) - f(a)}{b - a} \cdot (a - a) = 0.$$

und

$$g(b) = f(b) - f(a) - \frac{f(b) - f(a)}{b - a} \cdot (b - a) = f(b) - f(a) - (f(b) - f(a)) = 0.$$

Damit erfüllt die Funktion g die Voraussetzung des Satzes von Rolle. Also gibt es ein $c \in (a, b)$, so dass

$$\frac{d}{dx}g(c) = 0$$

gilt. Setzen wir hier die Definition von g ein, so haben wir

$$\begin{aligned} \frac{d}{dx}g(c) &= \frac{d}{dx}f(c) - \frac{f(b) - f(a)}{b - a} = 0 \\ \Rightarrow \frac{d}{dx}f(c) &= \frac{f(b) - f(a)}{b - a} \end{aligned} \quad \square$$

Abbildung 3.7 zeigt die geometrische Bedeutung des Mittelwert-Satzes: Es gibt eine Tangente an die Funktion, die die selbe Steigung hat wie die Sekante, die durch die Punkte $\langle a, f(a) \rangle$ und $\langle b, f(b) \rangle$ geht.

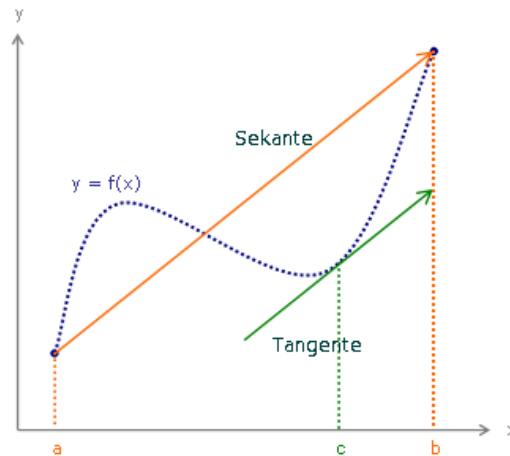


Abbildung 3.7: Geometrische Bedeutung des Mittelwert-Satzes.

Satz 50 (Erweiterter Mittelwert-Satz) Sind die Funktion $f, g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ für alle $x \in [a, b]$ differenzierbar und gilt $\frac{d}{dx}g(x) \neq 0$ für alle $x \in [a, b]$, so gilt:

$$\exists c \in (a, b) : \frac{f'(c)}{g'(c)} = \frac{f(b) - f(a)}{g(b) - g(a)}.$$

Bemerkung: Auf den ersten Blick mag es verwundern, dass nicht explizit $g(a) \neq g(b)$ gefordert wird. Dies folgt aber sofort aus der Bedingung $\forall x \in [a, b] : \frac{d}{dx}g(x) \neq 0$ und dem Satz von Rolle.

Aufgabe 18: Beweisen Sie den erweiterten Mittelwert-Satz. Betrachten Sie dazu die Funktion

$$h(x) := \alpha \cdot f(x) + \beta \cdot g(x)$$

und wählen Sie α und β geeignet.

Satz 51 (Guillaume François Antoine, Marquis de L'Hôpital, 1661 –1704)

Die Funktionen $f, g : (a, b) \rightarrow \mathbb{R}$ seien differenzierbar, es sei $c \in (a, b)$ und es gelte

1. $f(c) = g(c) = 0$
2. $\forall x \in (a, b) : g'(x) \neq 0$.
3. $\lim_{x \rightarrow a} \frac{f'(x)}{g'(x)}$ existiert.

Dann gilt

$$\lim_{x \rightarrow c} \frac{f(x)}{g(x)} = \lim_{x \rightarrow c} \frac{f'(x)}{g'(x)}.$$

Beweis: Da die Funktion f und g im Punkt c differenzierbar sind, gibt es Funktionen $r_1(h)$ und $r_2(h)$, so dass gilt:

1. $f(c+h) = f(c) + h \cdot f'(c) + r_1(h)$ mit $\lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_1(h)}{h} = 0$.
2. $g(c+h) = g(c) + h \cdot g'(c) + r_2(h)$ mit $\lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_2(h)}{h} = 0$.

Wir haben die folgende Kette von Gleichungen:

$$\begin{aligned}
 \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(c+h)}{g(c+h)} &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(c) + h \cdot f'(c) + r_1(h)}{g(c) + h \cdot g'(c) + r_2(h)} \\
 &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{h \cdot f'(c) + r_1(h)}{h \cdot g'(c) + r_2(h)} \\
 &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f'(c) + \frac{r_1(h)}{h}}{g'(c) + \frac{r_2(h)}{h}} \\
 &= \frac{f'(c) + \lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_1(h)}{h}}{g'(c) + \lim_{h \rightarrow 0} \frac{r_2(h)}{h}} \\
 &= \frac{f'(c)}{g'(c)} \quad \square
 \end{aligned}$$

Beispiel: Mit dem Satz von L'Hôpital können wir nun den Grenzwert $\lim_{x \rightarrow 0} \frac{\sin(x)}{x}$ noch einmal berechnen:

$$\lim_{x \rightarrow 0} \frac{\sin(x)}{x} = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{\cos(x)}{1} = \cos(0) = 1.$$

Der Satz von L'Hôpital behält seine Gültigkeit, wenn x gegen Unendlich strebt. Sind $f, g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ differenzierbare Funktionen, so dass der Grenzwert

$$\lim_{x \rightarrow \infty} \frac{f'(x)}{g'(x)}$$

existiert, und gilt entweder

$$\left(\lim_{x \rightarrow \infty} f(x) = 0 \wedge \lim_{x \rightarrow \infty} g(x) = 0 \right) \quad \vee \quad \left(\lim_{x \rightarrow \infty} f(x) = \infty \wedge \lim_{x \rightarrow \infty} g(x) = \infty \right)$$

so folgt

$$\lim_{x \rightarrow \infty} \frac{f(x)}{g(x)} = \lim_{x \rightarrow \infty} \frac{f'(x)}{g'(x)}.$$

Wir geben ein Beispiel. Es gilt

$$\lim_{x \rightarrow \infty} \frac{x}{\exp(x)} = \lim_{x \rightarrow \infty} \frac{1}{\exp(x)} = 0.$$

Der Satz von L'Hôpital lässt sich iteriert anwenden. Beispielsweise gilt

$$\lim_{x \rightarrow \infty} \frac{x^2}{\exp(x)} = \lim_{x \rightarrow \infty} \frac{2 \cdot x}{\exp(x)} = \lim_{x \rightarrow \infty} \frac{2}{\exp(x)} = 0.$$

Aufgabe 19: Zeigen Sie, dass für alle natürlichen Zahlen n gilt:

$$\lim_{x \rightarrow \infty} \frac{x^n}{\exp(x)} = 0.$$

Damit sehen wir, dass die Exponential-Funktion schneller wächst als jede Potenz.

3.5 Monotonie und Konvexität

Definition 52 (monoton) Eine Funktion $f : D \rightarrow \mathbb{R}$ ist *monoton steigend* g.d.w.

$$\forall x, y \in D : x < y \rightarrow f(x) \leq f(y)$$

gilt. Die Funktion f ist *streng monoton steigend*, wenn die schärfere Bedingung

$$\forall x, y \in D : x < y \rightarrow f(x) < f(y)$$

erfüllt ist. Weiter heißt f *monoton fallend*, wenn

$$\forall x, y \in D : x < y \rightarrow f(x) \geq f(y)$$

gilt. Analog ist f *streng monoton fallend*, falls die Bedingung

$$\forall x, y \in D : x < y \rightarrow f(x) > f(y)$$

erfüllt ist.

Satz 53 Eine differenzierbare Funktion $f : D \rightarrow \mathbb{R}$ ist genau dann monoton steigend, wenn gilt:

$$\forall x \in D : f'(x) \geq 0.$$

Beweis: Wir nehmen zunächst an, dass f monoton steigend ist und zeigen, dass dann $f'(x) \geq 0$ gilt. Die Ableitung ist definiert als der Grenzwert

$$f'(x) = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(x+h) - f(x)}{h}.$$

Wir zeigen, dass der Differenzial-Quotient

$$\frac{f(x+h) - f(x)}{h}$$

für alle $h \neq 0$ größer oder gleich 0 ist. Zm Nachweis dieser Behauptung führen wir eine Fallunterscheidung bezüglich des Vorzeichens von h durch.

1. Fall: $h > 0$.

Dann folgt aus der Monotonie von f , dass $f(x+h) \geq f(x)$ ist. Also gilt $f(x+h) - f(x) \geq 0$ und daraus folgt

$$\frac{f(x+h) - f(x)}{h} \geq 0.$$

2. Fall: $h < 0$.

Jetzt folgt aus der Monotonie von f die Ungleichung $f(x+h) \leq f(x)$. Also haben wir $f(x+h) - f(x) \leq 0$. Wegen $h < 0$ gilt dann

$$\frac{f(x+h) - f(x)}{h} \geq 0.$$

Da der Differenzial-Quotient in jedem Fall größer-gleich 0 ist, muss $f'(x) \geq 0$ gelten.

Wir nehmen nun an, dass für alle $x \in D$ die Ungleichung $f'(x) \geq 0$ gilt und zeigen, dass f dann monoton steigend ist. Diesen Beweis führen wir indirekt. Wir nehmen an, es gäbe $x, y \in D$ mit

$$x < y \quad \text{aber} \quad f(x) > f(y).$$

Nach dem Mittelwert-Satz der Differenzial-Rechnung gibt es dann ein $z \in [x, y]$, so dass

$$f'(z) = \frac{f(y) - f(x)}{y - x}$$

gilt. Aus $x < y$ folgt $y - x \geq 0$ und aus $f(x) > f(y)$ folgt $f(y) - f(x) < 0$. Damit hätten wir dann aber $f'(z) < 0$ im Widerspruch zur Voraussetzung. \square

In Analogie zum letzten Satz kann gezeigt werden, dass eine differenzierbare Funktion $f : D \rightarrow \mathbb{R}$ genau dann monoton fallend ist, wenn für alle $x \in D$ die Ungleichung $f'(x) \leq 0$ gilt.

Aufgabe 20: Die Funktion $f : D \rightarrow \mathbb{R}$ sei differenzierbar und es gelte

$$\forall x \in D : f'(x) > 0.$$

Zeigen Sie, dass die Funktion f dann streng monoton steigend ist.

Bemerkung: Die Funktion $x \mapsto x^3$ ist streng monoton steigend, aber an der Stelle $x = 0$ verschwindet die Ableitung dieser Funktion. Dies zeigt, dass sich die Aussage des letzten Satzes nicht umkehren lässt.

Definition 54 (strenges lokales Minimum)

Eine Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ hat im Punkt $\bar{x} \in \mathbb{R}$ ein *strenges lokales Minimum*, wenn gilt:

$$\exists \varepsilon \in \mathbb{R}_+ : \forall x \in \mathbb{R} : |x - \bar{x}| < \varepsilon \wedge x \neq \bar{x} \rightarrow f(x) > f(\bar{x}).$$

Bemerkung: Der Begriff des *strengen lokalen Maximum* lässt sich analog definieren.

Satz 55 Die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ sei zweimal differenzierbar, die zweite Ableitung $f''(x)$ sei stetig und für ein $x_0 \in \mathbb{R}$ gelte

$$f'(x_0) = 0 \wedge f''(x_0) > 0.$$

Dann hat die Funktion f in x_0 ein strenges lokales Minimum.

Beweis: Da die zweite Ableitung $f''(x)$ stetig ist, können wir $\varepsilon := f''(x_0) > 0$ setzen und finden dann ein $\delta > 0$, so dass

$$\forall x \in \mathbb{R} : |x - x_0| < \delta \rightarrow |f''(x) - f''(x_0)| < \varepsilon = f''(x_0).$$

gilt. Daraus folgt, dass für alle $x \in \mathbb{R}$ mit $|x - x_0| < \delta$ die Ungleichung

$$f''(x_0) - |f''(x) - f''(x_0)| > 0$$

gilt. Wir behaupten, dass dann

$$f''(x) > 0 \quad \text{für alle } x \in \mathbb{R} \text{ mit } |x - x_0| < \delta \tag{3.5}$$

gilt. Zum Nachweis dieser Behauptung führen wir eine Fallunterscheidung bezüglich der relativen Größe von $f''(x)$ und $f''(x_0)$ durch.

1. Fall: $f''(x) < f''(x_0)$. Dann gilt

$$|f''(x) - f''(x_0)| = f''(x_0) - f''(x).$$

Also folgt aus der Ungleichung $f''(x_0) - |f''(x) - f''(x_0)| > 0$ die Ungleichung

$$f''(x_0) - (f''(x_0) - f''(x)) > 0$$

und wegen $f''(x_0) - (f''(x_0) - f''(x)) = f''(x)$ haben wir damit die Behauptung $f''(x) > 0$ gezeigt.

2. Fall: $f''(x) \geq f''(x_0)$.

In diesem Fall folgt die Behauptung sofort aus der Voraussetzung $f''(x_0) > 0$ und der Transitivität der Relation $>$.

Die Ungleichung (3.5) zeigt uns, dass die Funktion $x \mapsto f'(x)$ in der δ -Umgebung von x_0 streng monoton steigend ist. Da außerdem $f'(x_0) = 0$ gilt, folgt insgesamt

$$f'(x) < 0 \quad \text{für alle } x \in U_\delta(x_0) \text{ mit } x < x_0 \quad \text{und}$$

$$f'(x) > 0 \quad \text{für alle } x \in U_\delta(x_0) \text{ mit } x > x_0.$$

Damit ist die Funktion f innerhalb der δ -Umgebung $U_\delta(x_0)$ für $x < x_0$ streng monoton wachsend und für $x > x_0$ streng monoton fallend. Dann muss f aber ein Maximum in x_0 haben. \square

Bemerkung: Falls für die Funktion f die Bedingung

$$f'(x_0) = 0 \wedge f''(x_0) > 0.$$

erfüllt ist, dann hat die Funktion an der Stelle x_0 ein strenges lokales Minimum.

Definition 56 (konvex, konkav) Eine Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ heißt *konvex* genau dann, wenn

$$\forall x_1, x_2 \in \mathbb{R} : \forall t \in [0, 1] : f(t \cdot x_1 + (1 - t) \cdot x_2) \leq t \cdot f(x_1) + (1 - t) \cdot f(x_2)$$

gilt. Geometrisch bedeutet dies, dass die Funktionswerte der Funktion f unterhalb der Sekante durch die Punkte $\langle x_1, f(x_1) \rangle$ und $\langle x_2, f(x_2) \rangle$ liegen.

Eine Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ heißt *konkav* genau dann, wenn

$$\forall x_1, x_2 \in \mathbb{R} : \forall t \in [0, 1] : f(t \cdot x_1 + (1 - t) \cdot x_2) \geq t \cdot f(x_1) + (1 - t) \cdot f(x_2)$$

gilt. Hier liegen die Funktionswerte der Funktion f also oberhalb der Sekante durch die Punkte $\langle x_1, f(x_1) \rangle$ und $\langle x_2, f(x_2) \rangle$.

Lemma 57 (Invarianz der Konvexität unter linearen Transformationen)

Die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ sei konvex und es sei $\alpha \in \mathbb{R}$. Definieren wir die Funktion $g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ als

$$g(x) := f(x) + \alpha \cdot x,$$

so ist auch die Funktion g konvex. Eine entsprechende Aussage gilt auch für konkave Funktionen.

Aufgabe 21: Beweisen Sie das vorangehende Lemma.

Satz 58 Die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ sei zweimal differenzierbar und die Funktion $x \mapsto f''(x)$ sei stetig. Dann gilt

$$f \text{ konvex} \quad \Leftrightarrow \quad \forall x \in \mathbb{R} : f''(x) \geq 0.$$

Beweis: Wir spalten den Beweis in zwei Teile auf.

“ \Rightarrow ”: Wir führen den Nachweis indirekt und nehmen an, dass es ein $x_0 \in \mathbb{R}$ gibt, so dass $f''(x_0) < 0$ ist. Ähnlich wie bei Beweis von Satz 55 folgt daraus, dass es eine δ_1 -Umgebung $U_{\delta_1}(x_0)$ gibt, so dass

$$f''(x) < 0 \quad \text{für alle } x \in U_{\delta_1}(x_0)$$

gilt. Wir definieren eine Funktion $g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ durch

$$g(x) := f(x) - x \cdot f'(x_0).$$

Dann gilt

$$g'(x) = f'(x) - f'(x_0) \quad \text{und} \quad g''(x) = f''(x).$$

Daraus folgt durch Einsetzen

$$g'(x_0) = 0 \quad \text{und} \quad g''(x_0) < 0.$$

Damit hat die Funktion g im Punkt x_0 ein lokales Maximum. Also gibt es eine δ_2 -Umgebung von x_0 , so dass

$$g(x) < g(x_0) \quad \text{für alle } x \in U_{\delta_2}(x_0)$$

gilt. O.B.d.A. können wir voraussetzen, dass $\delta_2 \leq \delta_1$ gilt. Nach dem Lemma 57 wissen wir,

dass die Funktion g ebenfalls konvex ist. Definieren wir $x_1 := x_0 - \frac{\delta_2}{2}$, $x_2 := x_0 + \frac{\delta_2}{2}$ und $t := \frac{1}{2}$, so folgt also

$$t \cdot g(x_1) + (1-t) \cdot g(x_2) \geq g(t \cdot x_1 + (1-t) \cdot x_2) \quad (3.6)$$

Nun gilt

$$t \cdot x_1 + (1-t) \cdot x_2 = \frac{1}{2} \cdot x_0 - \frac{1}{2} \cdot \frac{\delta_2}{2} + \frac{1}{2} \cdot x_0 + \frac{1}{2} \cdot \frac{\delta_2}{2} = x_0.$$

Damit folgt aus der Ungleichung (3.6) die Ungleichung

$$\frac{1}{2} \cdot g(x_1) + \frac{1}{2} \cdot g(x_2) \geq g(x_0) \quad (3.7)$$

Andererseits folgt aus der Tatsache, dass sowohl x_1 als auch x_2 in der δ_1 -Umgebung von x_0 liegen, dass

$$g(x_1) < g(x_0) \quad \text{und} \quad g(x_2) < g(x_0)$$

gilt. Multiplizieren wir diese beiden Gleichungen mit $\frac{1}{2}$ und addieren sie, so ergibt sich

$$\frac{1}{2} \cdot g(x_1) + \frac{1}{2} \cdot g(x_2) < g(x_0).$$

Diese Ungleichung steht aber im Widerspruch zur Ungleichung (3.7).

“ \Leftarrow ”: Es seien x_1, x_2 und $t \in [0, 1]$ gegeben. O.B.d.A. sei weiter $x_1 < x_2$. Wir definieren zunächst

$$x_0 := t \cdot x_1 + (1-t) \cdot x_2$$

Es lässt sich sofort nachrechnen, dass dann $x_1 < x_0 < x_2$ gilt. Nach dem Mittelwert-Satz der Differenzial-Rechnung gibt es jeweils ein $c_1 \in [x_1, x_0]$ und ein $c_2 \in [x_0, x_2]$, so dass

$$f'(c_1) = \frac{f(x_0) - f(x_1)}{x_0 - x_1} \quad \text{und} \quad f'(c_2) = \frac{f(x_2) - f(x_0)}{x_2 - x_0}$$

gilt. Da $f''(x) \geq 0$ ist, wissen wir außerdem, dass die Funktion $f'(x)$ monoton steigend ist. Da offenbar $c_1 \leq c_2$ ist, folgt daraus die Ungleichung $f'(c_1) \leq f'(c_2)$ und damit gilt

$$\frac{f(x_0) - f(x_1)}{x_0 - x_1} \leq \frac{f(x_2) - f(x_0)}{x_2 - x_0}. \quad (3.8)$$

Es gilt

$$x_0 - x_1 = t \cdot x_1 + (1-t) \cdot x_2 - x_1 = (1-t) \cdot (x_2 - x_1)$$

und genauso sehen wir

$$x_2 - x_0 = x_2 - (t \cdot x_1 + (1-t) \cdot x_2) = t \cdot (x_2 - x_1).$$

Multiplizieren wir daher die Ungleichung (3.8) mit $t \cdot (1-t) \cdot (x_2 - x_1)$, so erhalten wir die Ungleichung

$$t \cdot (f(x_0) - f(x_1)) \leq (1-t) \cdot (f(x_2) - f(x_0)).$$

Addieren wir auf beiden Seiten der Gleichung $(1-t) \cdot f(x_0)$ und $t \cdot f(x_1)$ und setzen dann noch für x_0 den Wert $t \cdot x_1 + (1-t) \cdot x_2$ ein, so erhalten wir die Ungleichung

$$f(t \cdot x_1 + (1-t) \cdot x_2) \leq t \cdot f(x_1) + (1-t) \cdot f(x_2).$$

Das ist aber gerade die Konvexität der Funktion f . □

3.6 Die Exponential-Funktion

Wir wollen in diesem Abschnitt zeigen, dass für die früher definierte Exponential-Funktion, die wir als

$$\exp(x) := \sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{n!} \cdot x^n$$

definiert haben, die Gleichung

$$\exp(x) = e^x \quad \text{mit } e := \sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{n!}$$

gilt. Die oben definierte Zahl e hat den Wert

$$e = 2.718\,281\,828\,459\,045\,235\,360\,287\,471\,352\,662\,497\,757\,247\,093\,699\,959\,574\,966\,967\,627\,724 \dots$$

und wird als Eulersche Zahl (Leonhard Euler, 1707–1783) bezeichnet. Zum Nachweis der oben behaupteten Gleichung benötigen wir das folgende Lemma.

Lemma 59 Ist die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ für alle $x \in \mathbb{R}$ differenzierbar und gilt

$$f'(x) = 0 \quad \text{für alle } x \in \mathbb{R}$$

so ist die Funktion f konstant: Es gibt dann ein $c \in \mathbb{R}$ so dass

$$f(x) = c \quad \text{für alle } x \in \mathbb{R} \text{ ist.}$$

Beweis: Wir führen den Beweis indirekt und nehmen an, dass die Funktion f nicht konstant ist. Es gibt dann also zwei Zahlen $x_1, x_2 \in \mathbb{R}$, so dass

$$x_1 \neq x_2 \quad \text{und} \quad f(x_1) \neq f(x_2)$$

gilt. O.B.d.A. sei $x_1 < x_2$. Nach dem Mittelwert-Satz gibt es nun ein $c \in [x_1, x_2]$, so dass

$$f'(c) = \frac{f(x_2) - f(x_1)}{x_2 - x_1}$$

gilt. Nach Voraussetzung wissen wir, dass $f'(c) = 0$ ist. Also haben wir

$$0 = \frac{f(x_2) - f(x_1)}{x_2 - x_1}.$$

Multiplikation dieser Gleichung mit $x_2 - x_1$ liefert die Gleichung

$$0 = f(x_2) - f(x_1)$$

und daraus folgt sofort $f(x_1) = f(x_2)$. Damit ist die Annahme $f(x_1) \neq f(x_2)$ widerlegt. \square

Aufgabe 22: Zeigen Sie: Ist die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ zweimal differenzierbar und gilt $f''(x) = 0$ für alle $x \in \mathbb{R}$, so gibt es Zahlen $c, d \in \mathbb{R}$, so dass

$$\forall x \in \mathbb{R} : f(x) = c \cdot x + d$$

gilt. Überlegen Sie, wie Sie diese Aussage so verallgemeinern können, dass die verallgemeinerte Aussage für beliebige n -mal differenzierbare Funktionen $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ gilt, für deren n -te Ableitung

$$f^{(n)}(x) = 0 \quad \text{für alle } x \in \mathbb{R} \text{ ist.}$$

Aufgabe 23: Zeigen Sie, dass für alle $x \in \mathbb{R}$

$$\exp(x) \cdot \exp(-x) = 1$$

gilt. Folgern Sie daraus, dass die Exponential-Funktion keine Nulstelle hat.

Aus dem letzten Lemma folgt eine wichtige Charakterisierung der Exponential-Funktion.

Lemma 60 Die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ sei für alle $x \in \mathbb{R}$ differenzierbar und es gelte

$$f'(x) = \lambda \cdot f(x) \quad \text{für ein } c \in \mathbb{R}.$$

Dann gibt es ein $c \in \mathbb{R}$, so dass

$$f(x) = c \cdot \exp(\lambda \cdot x) \quad \text{für alle } x \in \mathbb{R} \text{ ist.}$$

Beweis: Wir definieren die Funktion $g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ als

$$g(x) := f(x) \cdot \exp(-\lambda \cdot x).$$

Dann ist die Funktion g differenzierbar und es gilt

$$\begin{aligned} g'(x) &= f'(x) \cdot \exp(-\lambda \cdot x) + f(x) \cdot (-\lambda) \cdot \exp(-\lambda \cdot x) \\ &= \lambda \cdot f(x) \cdot \exp(-\lambda \cdot x) - \lambda \cdot f(x) \cdot \exp(-\lambda \cdot x) \\ &= 0 \end{aligned}$$

Nach dem letzten Lemma (Lemma 59) muss die Funktion g konstant sein. Damit gilt

$$g(x) = g(0) = f(0) \cdot \exp(0) = f(0) \cdot 1 = f(0).$$

Wir definieren $c := f(0)$. Setzen wir in der letzten Gleichung die Definition der Funktion g ein, so haben wir

$$f(x) \cdot \exp(-\lambda \cdot x) = c.$$

Multiplizieren wir diese Gleichung mit $\exp(\lambda \cdot x)$ und berücksichtigen, dass wir in der letzten Aufgabe gezeigt haben, dass $\exp(\lambda \cdot x) \cdot \exp(-\lambda \cdot x) = 1$ ist, dann erhalten wir die Gleichung

$$f(x) = c \cdot \exp(\lambda \cdot x). \quad \square$$

Aus dem letzten Satz können wir nun die Funktional-Gleichung der Exponential-Funktion folgern.

Satz 61 (Funktional-Gleichung der Exponential-Funktion) Für alle $x, y \in \mathbb{R}$ gilt

$$\exp(x + y) = \exp(x) \cdot \exp(y).$$

Beweis: Für ein gegebenes, festes $y \in \mathbb{R}$ definieren wir die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ durch

$$f_y(x) := \exp(x + y).$$

Dann gilt

$$f'_y(x) = 1 \cdot \exp(x + y) = f_y(x).$$

Nach dem letzten Lemma gilt also

$$f_y(x) = c \cdot \exp(x). \quad (3.9)$$

Da diese Gleichung auch für $x = 0$ gilt und da $\exp(0) = 1$ ist, haben wir

$$f_y(0) = c.$$

Setzen wir hier die Definition von $f_y(x)$ ein, so folgt

$$\exp(0 + y) = c, \quad \text{also } c = \exp(y).$$

Setzen wir dies zusammen mit der Definition von f_y in Gleichung (3.9) ein, so erhalten wir

$$\exp(x + y) = \exp(y) \cdot \exp(x). \quad \square$$

Ist $n \in \mathbb{N}$ so können wir mit Hilfe der Funktional-Gleichung durch eine leichte Induktion nach n zeigen, dass

$$\exp(n) = e^n$$

ist. Aufgrund der Gleichung

$$\exp(x) \cdot \exp(-x) = 1$$

folgt daraus, dass auch für negative ganze Zahlen $m \in \mathbb{Z}$

$$\exp(m) = e^m$$

gilt, denn wenn $m = -n$ mit $n \in \mathbb{N}$ ist, haben wir

$$e^m = e^{-n} = \frac{1}{e^n} = \frac{1}{\exp(n)} = \exp(-n) = \exp(m).$$

Ist nun $\frac{p}{q} \in \mathbb{Q}$, wobei $p \in \mathbb{Z}$ und $q \in \mathbb{N}$ gilt, so haben wir nach dem bisher gezeigten

$$e^p = \exp(p).$$

Ziehen wir hier die q -te Wurzel, so haben wir

$$e^{\frac{p}{q}} = \sqrt[q]{\exp(p)} = \exp\left(\frac{p}{q}\right),$$

gezeigt, denn es gilt

$$\left(\exp\left(\frac{p}{q}\right)\right)^q = \exp\left(q \cdot \frac{p}{q}\right) = \exp(p).$$

Damit haben wir also nun für alle rationalen Zahlen $r \in \mathbb{Q}$ die Gleichung

$$e^r = \exp(r)$$

gezeigt. Daher macht es Sinn, für beliebige reelle Zahlen $x \in \mathbb{R}$ den Wert e^x als

$$e^x := \exp(x)$$

zu definieren.

Kapitel 4

Anwendungen der Theorie

In diesem Kapitel stellen verschiedene Anwendungen der bisher entwickelten Theorie vor. Zunächst zeigen wir, wie sich bestimmte transzendente Funktionen wie der natürliche Logarithmus und die trigonometrischen Funktionen effektiv mit Hilfe von Reihen berechnen lassen. Anschließend diskutieren wir, wann eine Funktion sich durch ein Polynom interpolieren lässt. Danach besprechen wir das Newton'sche Verfahren zur Bestimmung von Nullstellen, dass dann anwendbar ist, wenn die Funktion, deren Nullstelle bestimmt werden soll, differenzierbar ist. Außerdem untersuchen wir die Konvergenz von Fixpunkt-Verfahren und zeigen, wie sich lineare Gleichungs-Systeme mit Hilfe von Fixpunkt-Verfahren approximativ lösen lassen.

4.1 Taylor-Reihen

Es sei $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ eine Funktion, die beliebig oft differenzierbar ist. Wir stellen uns die Frage, ob es möglich ist, eine solche Funktion als Potenzreihe darzustellen, wir fragen also, ob es eine Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gibt, so dass

$$f(x) = \sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot x^n \quad (4.1)$$

gilt. Falls eine solche Folge $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ existiert, dann möchten wir diese Folge berechnen können. Wenn die Gleichung (4.1) gültig ist, dann können wir den Koeffizienten a_0 dadurch berechnen, dass wir in dieser Gleichung $x = 0$ setzen. Wir erhalten dann

$$f(0) = a_0 + \sum_{n=1}^{\infty} a_n \cdot 0^n = a_0. \quad (4.2)$$

Um den Koeffizienten a_1 zu berechnen, differenzieren wir Gleichung (4.1):

$$\frac{d}{dx} f(x) = a_1 \cdot 1 \cdot x^0 + \sum_{n=2}^{\infty} a_n \cdot n \cdot x^{n-1}. \quad (4.3)$$

Setzen wir in dieser Gleichung $x = 0$, so finden wir

$$\frac{d}{dx} f(0) = a_1 + \sum_{n=2}^{\infty} a_n \cdot n \cdot 0^{n-1} = a_1. \quad (4.4)$$

Allgemein können wir den Koeffizienten a_k dadurch bestimmen, dass wir Gleichung (4.1) k -mal nach x differenzieren und anschließend $x = 0$ setzen. Wir beweisen zunächst durch Induktion über

k , dass für alle $k \in \mathbb{N}$

$$\begin{aligned}
 f^{(k)}(x) &= \sum_{n=k}^{\infty} a_n \cdot n \cdot (n-1) \cdot \dots \cdot (n-(k-1)) \cdot x^{n-k} \\
 &= \sum_{n=k}^{\infty} a_n \cdot \left(\prod_{i=0}^{k-1} (n-i) \right) \cdot x^{n-k} \\
 &= \sum_{n=k}^{\infty} \frac{n!}{(n-k)!} \cdot a_n \cdot x^{n-k}
 \end{aligned} \tag{4.5}$$

gilt. Hierbei bezeichnet $f^{(k)}(x)$ die k -te Ableitung der Funktion f an der Stelle x .

I.A.: $k = 0$. Es gilt

$$\begin{aligned}
 f^{(0)}(x) &= f(x) \\
 &= \sum_{n=0}^{\infty} a_n \cdot x^n \\
 &= \sum_{n=k}^{\infty} \frac{n!}{(n-0)!} \cdot a_n \cdot x^{n-k}.
 \end{aligned}$$

I.S.: $k \mapsto k+1$. Es gilt

$$\begin{aligned}
 f^{(k+1)}(x) &= \frac{d}{dx} f^{(k)}(x) \\
 &\stackrel{IV}{=} \frac{d}{dx} \sum_{n=k}^{\infty} \frac{n!}{(n-k)!} \cdot a_n \cdot x^{n-k} \\
 &= \sum_{n=k+1}^{\infty} \frac{n!}{(n-k)!} \cdot (n-k) \cdot a_n \cdot x^{n-k-1} \\
 &= \sum_{n=k+1}^{\infty} \frac{n!}{(n-k-1)!} \cdot a_n \cdot x^{n-(k+1)} \\
 &= \sum_{n=k+1}^{\infty} \frac{n!}{(n-(k+1))!} \cdot a_n \cdot x^{n-(k+1)}
 \end{aligned}$$

Damit ist der Beweis von Gleichung (4.5) abgeschlossen. Setzen wir in dieser Gleichung für x den Wert 0 ein, so erhalten wir

$$\begin{aligned}
 f^{(k)}(0) &= \frac{k!}{(k-k)!} \cdot a_k + \sum_{n=k+1}^{\infty} \frac{n!}{(n-k)!} \cdot a_n \cdot 0^{n-k} \\
 &= k! \cdot a_k
 \end{aligned}$$

Dividieren wir diese Gleichung durch $k!$, so haben wir für die Koeffizienten der Taylor-Reihe die Formel

$$a_k = \frac{f^{(k)}(0)}{k!}$$

gefunden. Also definieren wir für eine Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, die im Punkt $x = 0$ beliebig oft differenzierbar ist, die der Funktion f zugeordnete *Taylor-Reihe* als

$$\text{taylor}(f, x) := \sum_{n=0}^{\infty} \frac{f^{(n)}(0)}{n!} \cdot x^n. \tag{4.6}$$

Im Allgemeinen wissen wir nicht, ob die Reihe $\text{taylor}(f, x)$ konvergiert. Selbst wenn die Reihe konvergiert folgt daraus noch nicht, dass $f(x) = \text{taylor}(f, x)$ ist. Als Beispiel dazu betrachten wir die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, die durch

$$f(x) := \begin{cases} \exp\left(-\frac{1}{x^2}\right) & \text{falls } x \neq 0 \\ 0 & \text{falls } x = 0 \end{cases}$$

definiert ist. Im Buch von Otto Forster [1] wird gezeigt, dass für diese Funktion die Werte sämtlicher Ableitungen an der Stelle $x = 0$ verschwinden. Damit gilt dann $\text{taylor}(f, x) = 0$.

Um zu untersuchen wann die Taylor-Reihe $\text{taylor}(f, x)$ gegen $f(x)$ konvergiert, definieren wir zu einer gegebenen Funktion f und einer natürlichen Zahl $n \in \mathbb{N}$ den *Abbruch-Fehler vom Grad n* als

$$\text{error}_n(x) := f(x) - \sum_{i=0}^n \frac{f^{(i)}(0)}{i!} \cdot x^i.$$

Wir berechnen eine Abschätzung für den Abbruch-Fehler $\text{error}_n(x)$. Dazu benutzen wir den erweiterten Mittelwert-Satz. Zunächst bemerken wir, dass für alle $k = 0, \dots, n$ die k -te Ableitung des Abbruch-Fehlers vom Grad n den Wert 0 hat:

$$\text{error}_n^{(k)}(0) = 0$$

Dies folgt aus der Definition des Abbruch-Fehlers, denn wir hatten die Taylor-Reihe ja gerade so definiert, dass Sie mit der Funktion f an der Stelle 0 in allen Ableitungen übereinstimmt. Jetzt wenden wir auf die Funktionen $\text{error}_n(x)$ und $g_0(x) := x^{n+1}$ in dem Intervall $[0, x]$ den erweiterten Mittelwert-Satz an. Dann gibt es ein $\chi_1 \in [0, x]$, so dass

$$\frac{\frac{d}{dx}\text{error}_n(\chi_1)}{\frac{d}{dx}g_0(\chi_1)} = \frac{\text{error}_n(x) - \text{error}_n(0)}{g_0(x) - g_0(0)} \quad (4.7)$$

gilt. Für die Ableitung der Funktion $g_0(x) = x^{n+1}$ finden wir $\frac{d}{dx}g_0(x) = (n+1) \cdot x^n$. Wegen $\text{error}_n(0) = 0$ und $g_0(0) = 0$ vereinfacht sich Gleichung (4.7) zu

$$\frac{\text{error}_n^{(1)}(\chi_1)}{(n+1) \cdot \chi_1^n} = \frac{\text{error}_n(x)}{x^{n+1}}. \quad (4.8)$$

Nun wenden wir in dem Intervall $[0, \chi_1]$ den erweiterten Mittelwert-Satz auf die beiden Funktionen $\text{error}_n^{(1)}(x)$ und $g_1(x) := (n+1) \cdot x^n$ an. Dann gibt es ein $\chi_2 \in [0, \chi_1]$, so dass

$$\frac{\frac{d}{dx}\text{error}_n^{(1)}(\chi_2)}{\frac{d}{dx}g_1(\chi_2)} = \frac{\text{error}_n^{(1)}(\chi_1) - \text{error}_n^{(1)}(0)}{g_1(\chi_1) - g_1(0)} \quad (4.9)$$

gilt. Für die Ableitung der Funktion $g_1(x) = (n+1) \cdot x^n$ finden wir $\frac{d}{dx}g_1(x) = (n+1) \cdot n \cdot x^{n-1}$. Wegen $\text{error}_n^{(1)}(0) = 0$ und $g_1(0) = 0$ vereinfacht sich Gleichung (4.9) unter Berücksichtigung von Gleichung (4.8) zu

$$\frac{\text{error}_n^{(2)}(\chi_2)}{(n+1) \cdot n \cdot \chi_2^{n-1}} = \frac{\text{error}_n^{(1)}(\chi_1)}{(n+1) \cdot \chi_1^n} = \frac{\text{error}_n(x)}{x^{n+1}}.$$

Dieses Spiel können wir fortsetzen. Wenn wir k -mal den erweiterten Mittelwert-Satz anwenden und $k \leq n$ ist, erhalten wir ein $\chi_k \in [0, \chi_{k-1}]$, so dass gilt:

$$\frac{\text{error}_n^{(k)}(\chi_k)}{\frac{(n+1)!}{(n+1-k)!} \cdot \chi_k^{n+1-k}} = \frac{\text{error}_n(x)}{x^{n+1}} \quad (4.10)$$

Um diese Behauptung per Induktion nach k zu beweisen, bemerken wir, dass der Induktions-Anfang $k = 1$ bereits bewiesen wurde. Im Induktions-Schritt wenden wir in dem Intervall $[0, \chi_k]$ auf die beiden Funktionen $error_n^{(k)}(\chi_k)$ und $g_k(x) := \frac{(n+1)!}{(n+1-k)!} \cdot x^{n+1-k}$ den erweiterten Mittelwert-Satz an. Wir finden dann ein $\chi_{k+1} \in [0, \chi_k]$, so dass

$$\frac{\frac{d}{dx} error_n^{(k)}(\chi_{k+1})}{\frac{d}{dx} g_k(\chi_{k+1})} = \frac{error_n^{(k)}(\chi_k) - error_n^{(k)}(0)}{g_k(\chi_k) - g_k(0)} \quad (4.11)$$

gilt. Für die Ableitung der Funktion $g_k(x)$ finden wir

$$\begin{aligned} \frac{d}{dx} g_k(x) &= \frac{(n+1)!}{(n+1-k)!} \cdot (n+1-k) \cdot x^{n+1-k-1} \\ &= \frac{(n+1)!}{(n+1-(k+1))!} \cdot x^{n+1-(k+1)} \\ &= g_{k+1}(x) \end{aligned}$$

Wegen $error_n^{(k)}(0) = 0$ und $g_k(0) = 0$ vereinfacht sich Gleichung (4.11) zu

$$\frac{error_n^{(k+1)}(\chi_{k+1})}{g_{k+1}(\chi_{k+1})} = \frac{error_n^{(k)}(\chi_k)}{g_{k+1}(\chi_k)}$$

Berücksichtigen wir hier noch die Induktions-Voraussetzung (4.10), so haben wir

$$\frac{error_n^{(k+1)}(\chi_{k+1})}{g_{k+1}(\chi_{k+1})} = \frac{error_n(x)}{x^{n+1}} \quad (4.12)$$

gefunden und dadurch die Formel (4.10) per Induktion nachgewiesen. Setzen wir in der Gleichung (4.10) für k den Wert n ein, so haben wir

$$\frac{error_n^{(n)}(\chi_n)}{(n+1)! \cdot \chi_n} = \frac{error_n(x)}{x^{n+1}} \quad (4.13)$$

gezeigt. Wir wenden nun den erweiterten Mittelwert-Satz auf die Funktionen $error_n^{(n)}(x)$ und $x \mapsto (n+1)! \cdot x$ an. Dann erhalten wir ein $\chi \in [0, \chi_n] \subseteq [0, x]$, so dass

$$\frac{\frac{d}{dx} error_n^{(n)}(\chi)}{\frac{d}{dx} ((n+1)! \cdot x)} = \frac{error_n^{(n)}(\chi_n) - error_n^{(n)}(0)}{(n+1)! \cdot \chi_n - (n+1)! \cdot 0} \quad (4.14)$$

gilt. Wegen $error_n^{(n)}(0) = 0$ haben wir also

$$\frac{error_n^{(n+1)}(\chi)}{(n+1)!} = \frac{error_n^{(n)}(\chi_n)}{(n+1)! \cdot \chi_n}. \quad (4.15)$$

Um diese Gleichung zu vereinfachen, erinnern wir daran, dass $error_n(x)$ als

$$error_n(x) = f(x) - \sum_{k=0}^n \frac{f^{(k)}(0)}{k!} \cdot x^k$$

definiert ist. Wenn wir die $(n+1)$ -te Ableitung der Funktion $error_n(x)$ bilden, dann bleibt von der Summe nichts über, es gilt also

$$error_n^{(n+1)}(x) = f^{n+1}(x).$$

Setzen wir dieses Ergebnis in Gleichung (4.15) ein und berücksichtigen Gleichung (4.13), so finden wir

$$\frac{f^{(n+1)}(\chi)}{(n+1)!} = \frac{error_n(x)}{x^{n+1}}. \quad (4.16)$$

Setzen wir hier die Definition von $error_n(x)$ ein und multiplizieren die Gleichung mit x^{n+1} , so haben wir gezeigt, dass es ein $\chi \in [0, x]$ gibt, so dass

$$f(x) = \sum_{k=0}^n \frac{f^{(k)}(0)}{k!} \cdot x^k + f^{(n+1)}(\chi) \cdot \frac{x^{n+1}}{(n+1)!} \quad (4.17)$$

gilt. Diese Formel bezeichnen wir als die *Taylor-Entwicklung* (Brook Taylor, 1685 – 1731) der Funktion f mit *Lagrange'schem Restglied* (Joseph Louis Lagrange, 1736 – 1813).

4.1.1 Beispiele von Taylor-Entwicklungen

Wir zeigen nun, wie wir transzendente Funktionen mit Hilfe der Taylor-Entwicklungen approximieren können. Dadurch werden diese Funktionen einer numerischen Behandlung zugänglich.

Berechnung des natürlichen Logarithmus

Wir beginnen mit dem natürlichen Logarithmus $x \mapsto \ln(x)$. Dieser ist als die Umkehrfunktion der Exponential-Funktion definiert, es gilt also

$$\ln(\exp(x)) = x.$$

Da die Exponential-Funktion immer positiv ist, ist der natürliche Logarithmus für $x \leq 0$ nicht definiert. Wir betrachten daher die Funktion $f(x) := \ln(1+x)$. Zunächst berechnen wir die Ableitungen dieser Funktion. Wir beweisen durch Induktion, dass für alle natürlichen Zahlen $n \geq 1$ die n -te Ableitung der Funktion f die folgende Form hat:

$$f^{(n)}(x) = (-1)^{n+1} \cdot \frac{(n-1)!}{(1+x)^n}$$

I.A.: $n = 1$. Es gilt

$$\frac{d}{dx} f(x) = \frac{d}{dx} \ln(1+x) = \frac{1}{1+x} = (-1)^{1+1} \cdot \frac{(1-1)!}{(1+x)^1}$$

I.S.: $n \mapsto n+1$. Wir haben

$$\begin{aligned} f^{(n+1)}(x) &= \frac{d}{dx} f^{(n)}(x) \\ &\stackrel{IV}{=} \frac{d}{dx} \left((-1)^{n+1} \cdot \frac{(n-1)!}{(1+x)^n} \right) \\ &= (-1)^{n+1} \cdot (n-1)! \cdot \frac{(-n)}{(1+x)^{n+1}} \\ &= (-1)^{(n+1)+1} \cdot \frac{n!}{(1+x)^{n+1}} \end{aligned}$$

Daraus folgt sofort

$$f^{(n)}(0) = (-1)^{n+1} \cdot \frac{(n-1)!}{(1+0)^n} = (-1)^{n+1} \cdot (n-1)!$$

Damit erhalten wir für die Taylor-Entwicklungen der Funktion $\ln(1+x)$ das Ergebnis

$$taylor(x \mapsto \ln(1+x), x) = \sum_{k=1}^{\infty} (-1)^{k+1} \cdot \frac{(k-1)! \cdot x^k}{k!} = \sum_{k=1}^{\infty} (-1)^{k+1} \cdot \frac{x^k}{k}. \quad (4.18)$$

Wir wollen nun zeigen, dass diese Taylor-Reihe tatsächlich gegen $\ln(1+x)$ konvergiert, wir wollen also zeigen, dass

$$taylor(x \mapsto \ln(1+x), x) = \ln(1+x)$$

gilt. Dazu betrachten wir die Taylor-Entwicklung mit dem Lagrange'schen Restglied:

$$\ln(1+x) = \sum_{k=1}^n (-1)^{k+1} \cdot \frac{x^k}{k} + (-1)^n \cdot \frac{1}{(1+\chi)^{n+1}} \cdot \frac{x^{n+1}}{n+1} \quad (4.19)$$

Für den Abbruch-Fehler haben wir also

$$\text{error}_n(x) = (-1)^n \cdot \frac{1}{(1+\chi)^{n+1}} \cdot \frac{x^{n+1}}{n+1}$$

mit $\chi \in [0, x]$ und für $x \in [0, 1]$ geht dieser Wert für $n \rightarrow \infty$ gegen 0. Damit haben wir insgesamt $\text{taylor}(x \mapsto \ln(1+x), x) = \ln(1+x)$ für $x \geq 0$ gezeigt und folglich können wir

$$\ln(1+x) = \sum_{k=1}^{\infty} (-1)^{k+1} \cdot \frac{x^k}{k}$$

schreiben.¹ Setzen wir hier für x den Wert 1 ein, so haben wir die Formel

$$\ln(2) = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k+1}}{k} = 1 - \frac{1}{2} + \frac{1}{3} - \frac{1}{4} + \frac{1}{5} \pm \dots \quad (4.20)$$

gefunden. Um den Abbruch-Fehler abzuschätzen, setzen wir in $\text{error}_n(x)$ für x den Wert 1 ein und finden

$$|\text{error}_n(1)| \leq \frac{1}{n+1}.$$

Um $\ln(2)$ also nach der obigen Formel auf eine Genauigkeit von 10^{-9} berechnen zu können, müßten wir 1 000 000 000 Terme aufsummieren! Es geht auch effizienter. Dazu ersetzen wir in Gleichung (4.18) x durch $-x$ und erhalten

$$\ln(1-x) = \sum_{k=1}^{\infty} (-1)^{k+1} \cdot \frac{(-x)^k}{k} = \sum_{k=1}^{\infty} (-1)^{k+1} \cdot \frac{(-1)^k \cdot x^k}{k} = - \sum_{k=1}^n \frac{x^k}{k} \quad (4.21)$$

Subtrahieren wir diese Gleichung von der Gleichung (4.19), so erhalten wir

$$\begin{aligned} \ln\left(\frac{1+x}{1-x}\right) &= \ln(1+x) - \ln(1-x) \\ &= \sum_{k=1}^{\infty} (-1)^{k+1} \cdot \frac{x^k}{k} + \sum_{k=1}^n \frac{x^k}{k} \\ &= \sum_{k=1}^{\infty} ((-1)^{k+1} + 1) \cdot \frac{x^k}{k} \\ &= 2 \cdot \sum_{n=0}^{\infty} \frac{x^{2 \cdot n+1}}{2 \cdot n+1} \end{aligned} \quad (4.22)$$

Setzen wir hier für x den Wert $\frac{1}{3}$, so erhalten wir

$$\ln\left(\frac{1+\frac{1}{3}}{1-\frac{1}{3}}\right) = \ln\left(\frac{\frac{4}{3}}{\frac{2}{3}}\right) = \ln(2) = 2 \cdot \sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{2 \cdot n+1} \cdot \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot n+1}$$

Um den Fehler e abzuschätzen, den wir erhalten, wenn wir diese Reihe nach dem Glied $2 \cdot n+1$ abbrechen, schätzen wir den Abbruch-Fehler wie folgt ab:

¹Die Formel gilt auch für für negative x , deren Betrag kleiner als 1 ist, aber das können wir mit unseren Mitteln nicht beweisen.

$$\begin{aligned}
&= \left| \ln\left(\frac{1+\frac{1}{3}}{1-\frac{1}{3}}\right) - 2 \cdot \sum_{k=0}^n \frac{1}{2 \cdot k+1} \cdot \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot k+1} \right| \\
&= 2 \cdot \left| \sum_{k=n+1}^{\infty} \frac{1}{2 \cdot k+1} \cdot \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot k+1} \right| \\
&\leq 2 \cdot \sum_{k=n+1}^{\infty} \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot k+1} = 2 \cdot \sum_{k=0}^{\infty} \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot n+2 \cdot k+3} \\
&= 2 \cdot \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot n+3} \sum_{k=0}^{\infty} \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot k} = 2 \cdot \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot n+3} \sum_{k=0}^{\infty} \left(\frac{1}{9}\right)^k \\
&= 2 \cdot \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot n+3} \frac{1}{1 - \frac{1}{9}} = 2 \cdot \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot n+3} \frac{9}{8} \\
&= \frac{1}{4} \cdot \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot n+1}
\end{aligned}$$

Wir wollen $\ln(2)$ auf eine Genauigkeit von 10^{-9} berechnen. Also wählen wir n so, dass gilt:

$$\begin{aligned}
&\frac{1}{4} \cdot \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot n+1} && \leq 10^{-9} \\
\Leftrightarrow &\left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot n+1} && \leq 4 \cdot 10^{-9} \\
\Leftrightarrow &-\ln(3) \cdot (2 \cdot n+1) && \leq \ln(4) - 9 \cdot \ln(10) \\
\Leftrightarrow &(2 \cdot n+1) && \geq \frac{9 \cdot \ln(10) - \ln(4)}{\ln(3)} \\
\Leftrightarrow &n \geq 0.5 \cdot \left(\frac{9 \cdot \ln(10) - \ln(4)}{\ln(3)} - 1 \right) && \approx 8.3 \\
\Leftrightarrow &n && \geq 9
\end{aligned}$$

Um $\ln(2)$ auf eine Genauigkeit von 10^{-9} zu berechnen reicht es also aus, wenn wir in der Formel (4.22) die ersten 9 Glieder der Summe berücksichtigen. Wir erhalten

$$\ln(2) \approx 2 \cdot \sum_{n=0}^9 \frac{1}{2 \cdot n+1} \left(\frac{1}{3}\right)^{2 \cdot n+1} \approx 0.69314718054981171974$$

Der wirkliche Fehler ist sogar noch kleiner, er beträgt etwa 10^{-11} . Das liegt daran, dass wir bei der Abschätzung der Summe durch die geometrische Reihe den Faktor $\frac{1}{2 \cdot k+1}$ vernachlässigt haben.

Das Verfahren, das wir oben benutzt haben um $\ln(2)$ zu berechnen, lässt sich verallgemeinern. Ist die Aufgabe gegeben, für eine gegebene reelle Zahl r den natürlichen Logarithmus $\ln(r)$ zu berechnen, so setzen wir

$$\begin{aligned}
&r = \frac{1+x}{1-x} \\
\Leftrightarrow &(1-x) \cdot r = 1+x \\
\Leftrightarrow &r - x \cdot r = 1+x \\
\Leftrightarrow &r - 1 = x + x \cdot r \\
\Leftrightarrow &r - 1 = x \cdot (1+r) \\
\Leftrightarrow &\frac{r-1}{r+1} = x
\end{aligned}$$

Bei gegebenem r bestimmen wir also x nach der Formel $x = \frac{r-1}{r+1}$. Für das so bestimmte x gilt

dann

$$\ln(r) = \ln\left(\frac{1+x}{1-x}\right) = 2 \cdot \sum_{n=0}^{\infty} \frac{x^{2 \cdot n+1}}{2 \cdot n+1} \quad \text{mit } x = \frac{r-1}{r+1} \quad (4.23)$$

Falls $r \leq 2$ ist, gilt $x \leq \frac{1}{3}$ und dann konvergiert die obige Reihe sehr gut. In modernen Rechnern werden reelle Zahlen y in der Form

$$y = s \cdot r \cdot 2^n \quad \text{mit } s \in \{-1, +1\}, \quad r \in [1, 2) \quad \text{und } n \in \mathbb{Z}$$

dargestellt. Ist y positiv, so lässt sich der natürliche Logarithmus nach der Formel

$$\ln(y) = \ln(r) + n \cdot \ln(2)$$

berechnen, wobei $\ln(r)$ mit Hilfe der Formel (4.23) gefunden wird.

Aufgabe 24: Berechnen Sie die Taylor-Reihen für die Funktionen $x \mapsto \sin(x)$ und $x \mapsto \cos(x)$ geben Sie eine Abschätzung für den Abbruch-Fehler an. Folgern Sie außerdem die Gleichung

$$\exp(i \cdot x) = \cos(x) + i \cdot \sin(x),$$

bei der i die imaginäre Einheit bezeichnet, es gilt also $i \cdot i = -1$.

Berechnung des Arcus-Tangens

Die direkte Berechnung der Taylor-Reihe einer Funktion mit Hilfe der Formel (4.6) ist unter Umständen sehr mühsam. Wollen wir beispielsweise die Funktion $x \mapsto \arctan(x)$ in einer Taylor-Reihe entwickeln, so berechnen wir die ersten fünf Ableitungen wie folgt:

1. $\arctan^{(1)}(x) = \frac{1}{1+x^2}.$
2. $\arctan^{(2)}(x) = -2 \cdot \frac{x}{(1+x^2)^2}.$
3. $\arctan^{(3)}(x) = 2 \cdot \frac{3 \cdot x^2 - 1}{(1+x^2)^3}.$
4. $\arctan^{(4)}(x) = -24 \cdot \frac{x \cdot (x^2 - 1)}{(1+x^2)^4}.$
5. $\arctan^{(5)}(x) = 24 \cdot \frac{1 + 5 \cdot x^4 - 10 \cdot x^2}{(1+x^2)^5}.$

Aufgabe 25: Versuchen Sie, eine allgemeine Formel für die n -te Ableitung der Funktion

$$x \mapsto \arctan(x)$$

zu finden. Beweisen Sie die Richtigkeit Ihrer Formel.

Wir gehen in der Vorlesung einen anderen Weg um die Taylor-Reihe der Arkustangens-Funktion zu berechnen. Dazu stellen wir die Ableitung $\frac{d}{dx} \arctan(x)$ durch eine geometrische Reihe dar:

$$\frac{d}{dx} \arctan(x) = \frac{1}{1+x^2} = \sum_{n=0}^{\infty} (-x^2)^n = \sum_{n=0}^{\infty} (-1)^n \cdot x^{2 \cdot n}.$$

Die Ableitung der Taylor-Reihe muss diese Reihe ergeben und außerdem muss die Reihe an der Stelle 0 den Wert 0 haben, denn es gilt $\arctan(0) = 0$. Damit finden wir

$$\arctan(x) = \sum_{n=0}^{\infty} (-1)^n \cdot \frac{x^{2 \cdot n + 1}}{2 \cdot n + 1} \quad (4.24)$$

Da $\tan(\frac{\pi}{4}) = 1$, also $\arctan(1) = \frac{\pi}{4}$ ist, haben wir die Formel

$$\frac{\pi}{4} = \sum_{n=0}^{\infty} (-1)^n \cdot \frac{1}{2 \cdot n + 1} = 1 - \frac{1}{3} + \frac{1}{5} - \frac{1}{7} + \frac{1}{9} \pm \dots \quad (4.25)$$

gefunden. Für einen vollständigen Beweis dieser Formel müßten wir den Abbruch-Fehler nach der Lagrange'schen Formel berechnen. Das würde uns jetzt allerdings zuviel Zeit kosten.

Zur effizienten Berechnung von π ist die Formel (4.25) nicht geeignet. Aus dem Beweis des Kriteriums von Leibniz für die Konvergenz alternierender Summen folgt, dass der Abbruch-Fehler durch das erste weggelassene Glied abgeschätzt werden kann. Für die obige Formel heißt das, dass der Abbruch-Fehler wie folgt abgeschätzt werden kann:

$$\left| \arctan(x) - \sum_{k=0}^n (-1)^k \cdot \frac{1}{2 \cdot k + 1} \right| \leq \frac{1}{2 \cdot (n+1) + 1}$$

Überlegen wir, wieviele Glieder der Summe benötigt werden, um $\frac{\pi}{4}$ auf eine Genauigkeit von 10^{-9} zu berechnen. Dann muss n die folgende Ungleichung erfüllen:

$$\begin{aligned}
& \frac{1}{2 \cdot n + 3} \leq 10^{-9} \\
\Leftrightarrow & \quad 2 \cdot n + 3 \geq 10^9 \\
\Leftrightarrow & \quad n \geq 0.5 \cdot (10^9 - 3) \\
\Leftrightarrow & \quad n \geq 499\,999\,998.5 \\
\Leftrightarrow & \quad n \geq 499\,999\,999
\end{aligned}$$

Wir müßten wir also etwa 500 Millionen Terme aufsummieren um die geforderte Genauigkeit zu erreichen. Um eine Formel zu erhalten, die schneller konvergiert, gehen wir von den Additions-Theoremen von Sinus und Cosinus aus. Diese lauten:

$$\begin{aligned}
\sin(\alpha + \beta) &= \sin(\alpha) \cdot \cos(\beta) + \cos(\alpha) \cdot \sin(\beta) \quad \text{und} \\
\cos(\alpha + \beta) &= \cos(\alpha) \cdot \cos(\beta) - \sin(\alpha) \cdot \sin(\beta).
\end{aligned}$$

Teilen wir die erste Gleichung durch die zweite Gleichung, so folgt

$$\frac{\sin(\alpha + \beta)}{\cos(\alpha + \beta)} = \frac{\sin(\alpha) \cdot \cos(\beta) + \cos(\alpha) \cdot \sin(\beta)}{\cos(\alpha) \cdot \cos(\beta) - \sin(\alpha) \cdot \sin(\beta)}.$$

Da $\tan(x) = \frac{\sin(x)}{\cos(x)}$ ist, können wir die linke Seite dieser Gleichung durch $\tan(\alpha + \beta)$ ersetzen.

Auf der rechten Seite der Gleichung kürzen wir durch $\cos(\alpha) \cdot \cos(\beta)$. Dann erhalten wir

$$\tan(\alpha + \beta) = \frac{\frac{\sin(\alpha)}{\cos(\alpha)} + \frac{\sin(\beta)}{\cos(\beta)}}{1 - \frac{\sin(\alpha)}{\cos(\alpha)} \cdot \frac{\sin(\beta)}{\cos(\beta)}}.$$

Ersetzen wir hier noch die Brüche der Form $\frac{\sin(x)}{\cos(x)}$ durch $\tan(x)$, so haben wir das Additions-Theorem für den Tangens gefunden:

$$\tan(\alpha + \beta) = \frac{\tan(\alpha) + \tan(\beta)}{1 - \tan(\alpha) \cdot \tan(\beta)} \tag{4.26}$$

In dieser Formel setzen wir $\alpha = \arctan(x)$ und $\beta = \arctan(y)$ ein und erhalten

$$\tan(\arctan(x) + \arctan(y)) = \frac{\tan(\arctan(x)) + \tan(\arctan(y))}{1 - \tan(\arctan(x)) \cdot \tan(\arctan(y))}$$

Nehmen wir nun von beiden Seiten dieser Gleichung den Arkustangens und berücksichtigen, dass $\tan(\arctan(x)) = x$ und $\tan(\arctan(y)) = y$ gilt, so erhalten wir das Additions-Theorem für den Arkustangens:

$$\arctan(x) + \arctan(y) = \arctan\left(\frac{x + y}{1 - x \cdot y}\right) \tag{4.27}$$

Hier setzen wir nun $y := x$. Das liefert

$$2 \cdot \arctan(x) = \arctan\left(\frac{2 \cdot x}{1 - x^2}\right)$$

Wir wollen $\arctan(1)$ berechnen. Daher wählen wir x so, dass Folgendes gilt:

$$\begin{aligned}
& \frac{2 \cdot x}{1 - x^2} = 1 \\
\Leftrightarrow & \quad 2 \cdot x = 1 - x^2 \\
\Leftrightarrow & \quad x^2 + 2 \cdot x + 1 = 2 \\
\Leftrightarrow & \quad x = \sqrt{2} - 1
\end{aligned}$$

Wir können also $x = \sqrt{2} - 1$ wählen und dann π nach der Formel

$$\pi = 4 \cdot \arctan(1) = 8 \cdot \arctan(\sqrt{2} - 1) = 8 \cdot \sum_{n=0}^{\infty} (-1)^n \cdot \frac{(\sqrt{2} - 1)^{2 \cdot n + 1}}{2 \cdot n + 1} \quad (4.28)$$

berechnen. Wegen $\sqrt{2} - 1 \approx 0.4142$ konvergiert diese Reihe recht gut. Um auszurechnen, wieviele Glieder benötigt werden um π auf eine Genauigkeit von 10^{-9} zu berechnen, schätzen wir den Abbruch-Fehler mit dem Leibniz-Kriterium ab, wobei wir zur Vereinfachung den Nenner $2 \cdot n + 1$ durch 1 abschätzen:

$$\begin{aligned} 8 \cdot (\sqrt{2} - 1)^{2 \cdot (n+1) + 1} &\leq 10^{-9} \\ \Leftrightarrow \ln(8) + (2 \cdot n + 3) \cdot \ln(\sqrt{2} - 1) &\leq -9 \cdot \ln(10) \\ \Leftrightarrow (2 \cdot n + 3) \cdot \ln(\sqrt{2} - 1) &\leq -9 \cdot \ln(10) - \ln(8) \\ \Leftrightarrow 2 \cdot n + 3 &\geq -\frac{9 \cdot \ln(10) + \ln(8)}{\ln(\sqrt{2} - 1)} \\ \Leftrightarrow n &\geq -0.5 \cdot \left(\frac{9 \cdot \ln(10) + \ln(8)}{\ln(\sqrt{2} - 1)} + 3 \right) \approx 11.4 \end{aligned}$$

Also reicht es sicher aus, die ersten 12 Glieder der Summe zu berücksichtigen um π auf eine Genauigkeit von 10^{-9} zu berechnen. Führen wir die Rechnung durch, so finden wir

$$\pi \approx \sum_{k=0}^1 2(-1)^k \cdot \frac{(\sqrt{2} - 1)^{2 \cdot k + 1}}{2 \cdot k + 1} \approx 3.141592653601609.$$

Der tatsächliche Fehler ist hier kleiner als $2 \cdot 10^{-11}$.

Die Machin'sche Formel

Es gibt noch eine elegantere Möglichkeit, die Kreiszahl π mit Hilfe des Arkustangens zu berechnen. Es gilt nämlich die Machin'sche Formel (John Machin, 1686 – 1751):

$$\frac{\pi}{4} = 4 \cdot \arctan\left(\frac{1}{5}\right) - \arctan\left(\frac{1}{239}\right).$$

Beweis: Wegen $\frac{\pi}{4} = \arctan(1)$ ist die Machin'sche Formel äquivalent zu

$$\arctan(1) = 4 \cdot \arctan\left(\frac{1}{5}\right) - \arctan\left(\frac{1}{239}\right).$$

Wir addieren auf beiden Seiten dieser Gleichung den Wert $\arctan\left(\frac{1}{239}\right)$ und sehen dann, dass die Machin'sche Gleichung zu der Gleichung

$$\arctan(1) + \arctan\left(\frac{1}{239}\right) = 4 \cdot \arctan\left(\frac{1}{5}\right).$$

äquivalent ist. Wir wenden nun auf beiden Seiten dieser Gleichung das Additions-Theorem des Arkustangens an und finden

$$\arctan\left(\frac{1 + \frac{1}{239}}{1 - \frac{1}{239}}\right) = 2 \cdot \arctan\left(\frac{\frac{2}{5}}{1 - \frac{1}{25}}\right)$$

Dies vereinfachen wir zu

$$\arctan\left(\frac{240}{238}\right) = 2 \cdot \arctan\left(\frac{10}{24}\right)$$

Kürzen liefert

$$\arctan\left(\frac{120}{119}\right) = 2 \cdot \arctan\left(\frac{5}{12}\right)$$

Hier können wir auf der rechten Seite das Additions-Theorem des Arkustangens ein zweites Mal

anwenden und finden

$$\arctan\left(\frac{120}{119}\right) = \arctan\left(\frac{\frac{10}{12}}{1 - \frac{25}{12} \cdot \frac{25}{12}}\right)$$

Elementare Bruchrechnung zeigt die Gültigkeit der Gleichung

$$\frac{\frac{10}{12}}{1 - \frac{25}{12} \cdot \frac{25}{12}} = \frac{120}{119}.$$

Damit haben wir die Machin'sche Formel bewiesen. \square

Aufgabe 26: Leiten Sie die folgende Formel aus dem Additions-Theorem des Arcus-Tangens her und berechnen Sie damit π auf eine Genauigkeit von 10^{-9} :

$$\frac{\pi}{4} = 2 \cdot \arctan\left(\frac{1}{2}\right) - \arctan\left(\frac{1}{7}\right).$$

4.2 Polynom-Interpolation

Nach dem wir uns im letzten Abschnitt damit beschäftigt haben für eine gegebene Funktion f eine Folge von Polynomen zu konstruieren, deren Ableitungen im Punkt 0 mit der Funktion f übereinstimmen, zeigen wir jetzt, wie sich Polynome konstruieren lassen, die mit einer Funktion f an vorgegebenen Punkten übereinstimmen. Sind $n + 1$ Paare der Form

$$\langle x_0, y_0 \rangle, \langle x_1, y_1 \rangle, \dots, \langle x_n, y_n \rangle,$$

so besteht die Aufgabe der Polynom-Interpolation darin, ein Polynom $p(x)$ vom Grad n zu finden, so dass

$$\forall i \in \{0, 1, \dots, n\} : p(x_i) = y_i$$

gilt. Wir zeigen sofort, dass diese Aufgabe lösbar ist. Zu einer gegebenen Liste von $n + 1$ verschiedenen *Stützstellen*

$$[x_0, x_1, \dots, x_n]$$

definieren wir für alle $k \in \{0, 1, \dots, n\}$ das k -te Lagrange'sche Polynom vom Grad n wie folgt:

$$L_k([x_0, \dots, x_n]; x) := \prod_{\substack{i=0 \\ i \neq k}}^n \frac{x - x_i}{x_k - x_i} \quad (4.29)$$

Für die Folge der Stützstellen $[-1, 0, 1]$ lauten die Lagrange'schen Polynome beispielsweise

1. $L_0([-1, 0, 1]; x) := \frac{(x - 0) \cdot (x - 1)}{(-1 - 0) \cdot (-1 - 1)} = \frac{1}{2} \cdot x^2 - \frac{1}{2} \cdot x$
2. $L_1([-1, 0, 1]; x) := \frac{(x - (-1)) \cdot (x - 1)}{(0 - (-1)) \cdot (0 - 1)} = -x^2 + 1$
3. $L_2([-1, 0, 1]; x) := \frac{(x - (-1)) \cdot (x - 0)}{(1 - (-1)) \cdot (1 - 0)} = \frac{1}{2} \cdot x^2 + \frac{1}{2} \cdot x$

Ist eine Liste $[x_0, x_1, \dots, x_n]$ von $n + 1$ verschiedene Stützstellen gegeben, so haben die Lagrange'schen Polynome eine sehr nützliche Eigenschaft. Um diese Eigenschaft einfacher schreiben zu können, definieren wir für natürliche Zahlen j und k das sogenannte *Kronecker-Delta* wie folgt:

$$\delta_{k,j} = \begin{cases} 1 & \text{falls } j = k; \\ 0 & \text{falls } j \neq k. \end{cases} \quad (4.30)$$

Damit gilt nun

$$L_k([x_0, x_1, \dots, x_n]; x_j) = \delta_{k,j}. \quad (4.31)$$

Diese Eigenschaft lässt sich durch einfaches Nachrechnen bestätigen. Wir betrachten die Fälle $j = k$ und $j \neq k$ getrennt:

1. Fall: $j = k$. Dann haben wir

$$L_k([x_0, \dots, x_n]; x_k) = \prod_{\substack{i=0 \\ i \neq k}}^n \frac{x_k - x_i}{x_k - x_i} = 1 = \delta_{k,k}$$

2. Fall: $j \neq k$. Dann haben wir

$$\begin{aligned} L_k([x_0, \dots, x_n]; x_j) &= \prod_{\substack{i=0 \\ i \neq k}}^n \frac{x_j - x_i}{x_k - x_i} \\ &= \frac{(x_j - x_0) \cdots (x_j - x_j) \cdots (x_j - x_n)}{(x_k - x_0) \cdots (x_k - x_j) \cdots (x_k - x_n)} \\ &= 0 \\ &= \delta_{j,k} \end{aligned}$$

Die Eigenschaft (4.31) macht es jetzt einfach, Polynome zu konstruieren, die an den Stützstellen $[x_0, x_1, \dots, x_n]$ vorgegebene Werte y_0, y_1, \dots, y_n annehmen. Wir definieren

$$p(x) := \sum_{k=0}^n y_k \cdot L_k(x).$$

Dann gilt $p(x_j) = y_j$ für alle $j = 0, 1, \dots, n$, denn wir haben

$$p(x_j) = \sum_{k=0}^n y_k \cdot L_k(x_j) = \sum_{k=0}^n y_k \cdot \delta_{j,k} = y_j \cdot 1 = y_j.$$

Beispiel: Wollen wir ein Polynom $p(x)$ konstruieren, welches das Interpolations-Problem

$$\langle -1, 1 \rangle, \langle 0, 0 \rangle \text{ und } \langle 1, 1 \rangle$$

löst, so können wir mit den oben gefundenen Lagrange'schen Polynomen das Polynom $p(x)$ wie folgt definieren:

$$\begin{aligned} p(x) &= 1 \cdot L_0([-1, 0, 1]; x) + 0 \cdot L_1([-1, 0, 1]; x) + 1 \cdot L_2([-1, 0, 1]; x) \\ &= \left(\frac{1}{2} \cdot x^2 - \frac{1}{2} \cdot x\right) + \left(\frac{1}{2} \cdot x^2 + \frac{1}{2} \cdot x\right) \\ &= x^2 \end{aligned}$$

Aufgabe 27: Bei einer Klausur können insgesamt n Punkte erreicht werden. Bestimmen Sie ein Polynom $p(x)$ vom Grade 1, so dass

$$p(n) = 1.0 \quad \text{und} \quad p\left(\frac{n}{2}\right) = 4.0$$

gilt. Hat ein Teilnehmer einer Klausur k von n Punkten erreicht, so ist $p(k)$ die Note, mit der die Leistung bewertet wird.

4.2.1 Interpolation nach Newton

Bei der Rechnung mit den oben definierten Lagrange'schen Polynomen tritt in der Praxis ein Problem auf. Hat man für eine gegebene Zahl von Stützstellen das Interpolations-Problem gelöst und erhält man nun eine zusätzliche Stützstelle, so ist es erforderlich, alle Lagrange'schen Polynome noch einmal zu berechnen, denn die Lagrange'schen Polynome vom Grad $n + 1$ haben mit den Lagrange'schen Polynomen vom Grad n nur wenig zu tun. Hier ist der Ansatz von Newton besser geeignet. Bei dem Newton'schen (Sir Isaac Newton, 1643 – 1727) Ansatz schreibt sich ein

Interpolations-Polynom vom Grad n in der Form

$$\begin{aligned} p_n(x) &= \sum_{k=0}^n c_k \cdot \prod_{i=0}^{k-1} (x - x_i) \\ &= c_0 + c_1 \cdot (x - x_0) + c_2 \cdot (x - x_0) \cdot (x - x_1) + \cdots + c_n \cdot \prod_{i=0}^{n-1} (x - x_i) \end{aligned} \quad (4.32)$$

Der Vorteil dieses Ansatzes besteht darin, dass das Newton'sche Interpolations-Polynom vom Grad $n+1$ unmittelbar aus dem Newton'schen Interpolations-Polynom vom Grad n wie folgt hervorgeht:

$$p_{n+1}(x) = p_n(x) + c_{n+1} \cdot \prod_{i=0}^n (x - x_i).$$

Ist eine Interpolations-Aufgabe

$$\langle x_0, y_0 \rangle, \langle x_1, y_1 \rangle, \dots, \langle x_n, y_n \rangle,$$

gegeben, so können die Koeffizienten c_k für $k = 0, 1, \dots, n$ der Reihe nach wie folgt berechnet werden.

1. Um c_0 zu bestimmen, setzen wir in Gleichung (4.32) für x den Wert x_0 ein. Dann fallen alle Terme bis auf den ersten Term weg und wir erhalten

$$y_0 = c_0.$$

2. Um c_1 zu bestimmen, setzen wir in Gleichung (4.32) für x den Wert x_1 ein. Dann fallen alle Terme bis auf die ersten beiden Term weg und wir erhalten

$$y_1 = c_0 + c_1 \cdot (x_1 - x_0).$$

Setzen wir hier für c_0 den im letzten Schritt gefundenen Wert y_0 ein, so finden wir

$$c_1 = \frac{y_1 - y_0}{x_1 - x_0}.$$

3. Um c_2 zu bestimmen, setzen wir in Gleichung (4.32) für x den Wert x_2 ein. Dann fallen alle Terme bis auf die ersten drei Terme weg und wir erhalten

$$y_2 = c_0 + c_1 \cdot (x_2 - x_0) + c_2 \cdot (x_2 - x_0) \cdot (x_2 - x_1).$$

Hier setzen wir für c_0 und c_1 die in den letzten Schritten gefundenen Werte ein und haben dann

$$\begin{aligned} y_2 &= y_0 + \frac{y_1 - y_0}{x_2 - x_0} \cdot (x_2 - x_0) + c_2 \cdot (x_2 - x_0) \cdot (x_2 - x_1) \\ y_2 - y_0 &= \frac{y_1 - y_0}{x_2 - x_0} \cdot (x_2 - x_0) + c_2 \cdot (x_2 - x_0) \cdot (x_2 - x_1) \\ \frac{y_2 - y_0}{x_2 - x_0} &= \frac{y_1 - y_0}{x_2 - x_0} + c_2 \cdot (x_2 - x_1) \\ \frac{y_2 - y_0}{x_2 - x_0} - \frac{y_1 - y_0}{x_2 - x_0} &= c_2 \cdot (x_2 - x_1) \\ \frac{\frac{y_2 - y_0}{x_2 - x_0} - \frac{y_1 - y_0}{x_2 - x_0}}{x_2 - x_1} &= c_2 \end{aligned}$$

Die obige Rechnung gibt Anlaß zur Definition der sogenannten *dividierten Differenzen* vom Rang k , die wir jetzt für alle $k = 1, \dots, n$ durch Induktion über k definieren.

I.A.: $k = 1$. Für alle $i = 0, \dots, n$ setzen wir

$$[x_k]_{dd} := y_k.$$

I.S.: $k \mapsto k + 1$. Für $i = 0, \dots, n - k$ setzen wir

$$[x_i, x_{i+1}, \dots, x_{i+k}]_{dd} := \frac{[x_{i+1}, \dots, x_{i+k}]_{dd} - [x_i, \dots, x_{i+k-1}]_{dd}}{x_{i+k} - x_i}.$$

Die dividierten Differenzen der Ordnung $k + 1$ berechnen sich also aus den dividierten Differenzen der Ordnung k durch Bildung einer Differenz und einer anschließenden Division. Dieser Umstand erklärt ihren Namen. Für die Koeffizienten c_k in dem Newton'schen Ansatz (4.32) gilt nun

$$c_k = [x_0, x_1, \dots, x_k]_{dd}, \quad (4.33)$$

das Interpolations-Problem ein Polynom $p(x)$ zu finden, für das

$$p(x_0) = y_0, \quad p(x_1) = y_1, \quad \dots \quad \text{und} \quad p(x_n) = y_n$$

gilt, wird also durch das Polynom

$$p(x) = \sum_{k=0}^n [x_0, x_1, \dots, x_k]_{dd} \cdot \prod_{i=0}^{k-1} (x - x_i) \quad (4.34)$$

gelöst.

4.2.2 Der Interpolations-Fehler

Wir untersuchen als nächstes wie groß der Fehler bei der Polynom-Interpolation werden kann. Dazu beweisen wir zunächst den folgenden Hilfs-Satz.

Satz 62 Ist $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ eine Funktion, die n -mal differenzierbar ist und die $n + 1$ verschiedene Nullstellen

$$x_0 < x_1 < \dots < x_n$$

hat, so gibt es ein $\xi \in [x_0, x_n]$ mit $f^{(n)}(\xi) = 0$.

Beweis: Wir zeigen, dass für alle $k = 0, 1, \dots, n$ die k -te Ableitung $f^{(k)}(x)$ in dem Intervall $[x_0, x_n]$ mindestens $n + 1 - k$ verschiedene Nullstellen hat. Diesen Nachweis führen wir durch Induktion über k .

I.A.: $k = 0$. Es gilt $f^{(0)}(x) = f(x)$ und da die Funktion f nach Voraussetzung $n + 1$ Nullstelle hat, folgt die Behauptung.

I.S.: $k \mapsto k + 1$. Nach Induktions-Voraussetzung hat die Funktion $f^{(k)}(x)$ mindestens $n + 1 - k$ verschiedene Nullstellen. Nehmen wir an, diese Nullstellen seien der Größe nach geordnet als

$$y_1 < y_2 < \dots < y_{n+1-k}.$$

Wegen $k + 1 \leq n$ ist die Funktion $f^{(k)}(x)$ nach Voraussetzung differenzierbar und nach dem Satz von Rolle hat die Ableitung dieser Funktion jeweils zwischen zwei Nullstellen y_i und y_{i+1} eine Nullstelle, für $i = 1, \dots, n - k - 1$ gibt es also $z_i \in [y_i, y_{i+1}] \subseteq [x_0, x_n]$ mit

$$\frac{d}{dx} f^{(k)}(z_i) = f^{(k+1)}(z_i) = 0.$$

Setzen wir nun $k = n$, so sehen wir, dass die Funktion $f^{(n)}(x)$ in dem Intervall $[x_0, x_n]$ mindestens $n + 1 - n = 1$ Nullstellen hat, also gibt es das gesuchte $\xi \in [x_0, x_n]$. \square

Aufgabe 28: Es sei $p(x)$ ein Polynom vom Grad $n \geq 1$. Zeigen Sie, dass $p(x)$ höchstens n verschiedene Nullstellen hat. Folgern Sie daraus, dass es zu n gegebenen Paaren

$$\langle x_0, y_0 \rangle, \langle x_1, y_1 \rangle, \dots, \langle x_n, y_n \rangle,$$

genau ein Polynom $p(x)$ gibt, so dass $p(x_i) = y_i$ für alle $i = 0, 1, \dots, n$ gilt.

Satz 63 Ist die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ mindestens $(n + 1)$ -mal differenzierbar, ist $p(x)$ eine Polynom vom Grad kleiner gleich n , sind $x_0 < x_1 < \dots < x_n$ Punkte mit

$$f(x_i) = p(x_i) \quad \text{für alle } i = 0, 1, \dots, n,$$

und ist $\bar{x} \in [x_0, x_n]$, so gibt es ein $\zeta \in [x_0, x_n]$, so dass für den Interpolations-Fehler $f(\bar{x}) - p(\bar{x})$ gilt:

$$f(\bar{x}) - p(\bar{x}) = \frac{f^{(n+1)}(\zeta)}{(n+1)!} \cdot \prod_{i=0}^n (\bar{x} - x_i).$$

Beweis: Falls $\bar{x} \in \{x_0, x_1, \dots, x_n\}$ ist, dann folgt sofort $f(\bar{x}) - p(\bar{x}) = 0$ und da dann auch $\prod_{i=0}^n (\bar{x} - x_i) = 0$ ist, ist die Behauptung in diesem Fall offensichtlich. Andernfalls definieren wir die Funktion

$$g(x) := f(x) - p(x) - \left(\prod_{i=0}^n \frac{x - x_i}{\bar{x} - x_i} \right) \cdot (f(\bar{x}) - p(\bar{x})).$$

Mit f ist auch die Funktion g mindestens $(n+1)$ -mal differenzierbar. Außerdem gilt wegen $p(x_k) = f(x_k)$ für alle $k = 0, 1, \dots, n$

$$g(x_k) = f(x_k) - p(x_k) - \left(\prod_{i=0}^n \frac{x_k - x_i}{\bar{x} - x_i} \right) \cdot (f(\bar{x}) - p(\bar{x})) = 0,$$

denn der Faktor $x_k - x_i$ verschwindet im Falle $i = k$. Außerdem haben wir

$$\begin{aligned} g(\bar{x}) &= f(\bar{x}) - p(\bar{x}) - \left(\prod_{i=0}^n \frac{\bar{x} - x_i}{\bar{x} - x_i} \right) \cdot (f(\bar{x}) - p(\bar{x})) \\ &= f(\bar{x}) - p(\bar{x}) - 1 \cdot (f(\bar{x}) - p(\bar{x})) \\ &= 0. \end{aligned}$$

Damit hat die Funktion insgesamt $n+2$ verschiedene Nullstellen. Wenden wir jetzt auf die Funktion g den eben gezeigten Hilfs-Satz an, so finden wir ein $\zeta \in [x_0, x_n]$ mit

$$g^{(n+1)}(\zeta) = 0.$$

Wir bilden die $(n+1)$ -te Ableitung von g und finden

$$g^{(n+1)}(x) = f^{(n+1)}(x) - 0 - (n+1)! \cdot \left(\prod_{i=0}^n \frac{1}{\bar{x} - x_i} \right) \cdot (f(\bar{x}) - p(\bar{x})), \quad (4.35)$$

denn die $(n+1)$ -te Ableitung eines Polynoms vom Grad n ist 0 und die $(n+1)$ -te Ableitung des Polynoms

$$\prod_{i=0}^n \frac{x - x_i}{\bar{x} - x_i}$$

ist $(n+1)!$ mal der Koeffizient der Potenz x^{n+1} . Setzen wir in Gleichung (4.35) die Nullstelle ζ ein, so finden wir

$$\begin{aligned} 0 &= f^{(n+1)}(\zeta) - (n+1)! \cdot \left(\prod_{i=0}^n \frac{1}{\bar{x} - x_i} \right) \cdot (f(\bar{x}) - p(\bar{x})) \\ \Leftrightarrow (n+1)! \cdot \left(\prod_{i=0}^n \frac{1}{\bar{x} - x_i} \right) \cdot (f(\bar{x}) - p(\bar{x})) &= f^{(n+1)}(\zeta) \\ \Leftrightarrow f(\bar{x}) - p(\bar{x}) &= \frac{f^{(n+1)}(\zeta)}{(n+1)!} \cdot \prod_{i=0}^n (\bar{x} - x_i). \quad \square \end{aligned}$$

Aufgabe 29: Für die Funktion $x \mapsto \sin(x)$ soll im Intervall $[0, \frac{\pi}{2}]$ eine Tabelle erstellt werden, so dass der bei linearer Interpolation entstehende Interpolations-Fehler kleiner als 10^{-5} ist. Das Intervall $[0, \frac{\pi}{2}]$ soll zu diesem Zweck in gleich große Intervalle aufgeteilt werden. Berechnen Sie die Anzahl der Einträge, die für die Erstellung der Tabelle notwendig ist.

4.3 Der Banach'sche Fixpunkt-Satz

Der Banach'sche Fixpunkt-Satz, der 1922 von Stefan Banach (1892 – 1945) bewiesen wurde, ist ein wichtiges Hilfsmittel zur Lösung von Gleichungen. Wir werden den Banach'schen Fixpunkt-Satz nur für den Spezialfall der reellen Zahlen formulieren und beweisen. In der Mathematik wird dieser Satz in einem abstrakteren Rahmen verwendet, die Menge der reellen Zahlen wird dann durch einen beliebigen metrischen Raum ersetzt.

Definition 64 (kontrahierend) Eine Funktion $f : [a, b] \rightarrow [a, b]$ ist eine *kontrahierende Abbildung* wenn es eine Zahl $q < 1$ gibt, so dass gilt:

$$\forall x, y \in \mathbb{R} : |f(x) - f(y)| \leq q \cdot |x - y|.$$

Wir nennen q den Kontraktions-Koeffizienten.

Beispiel: Die Funktion $\cos : [0, 1] \rightarrow [0, 1]$ ist eine kontrahierende Abbildung. Zunächst müssen wir uns davon überzeugen, dass diese Funktion wohldefiniert ist. Dazu muss aus $x \in [0, 1]$ folgen, dass auch $\cos(x) \in [0, 1]$ gilt. Dies folgt aus $\cos(0) = 1$, $\cos(1) \approx 0.54$ und der Tatsache, dass die Kosinus-Funktion in dem Intervall $[0, 1]$ monoton fallend ist, denn $\frac{d}{dx} \cos(x) = -\sin(x)$ und für alle $x \in [0, \pi]$ gilt $\sin(x) \geq 0$. Seien nun Zahlen $x, y \in [0, 1]$ gegeben. Nach dem Mittelwert-Satz der Differenzial-Rechnung gibt es dann ein $\zeta \in [x, y]$ mit

$$\frac{\cos(x) - \cos(y)}{x - y} = \cos'(\zeta) = -\sin(\zeta).$$

Die Sinus-Funktion nimmt in dem Intervall $[0, 1]$ ihr Maximum in dem Punkt 1 an, es gilt

$$\forall t \in [0, 1] : \sin(t) \leq \sin(1) \approx 0.8414709848 \dots \leq 0.85.$$

Also haben wir folgende Abschätzung

$$|\cos(x) - \cos(y)| = \sin(\zeta) \cdot |x - y| \leq 0.85 \cdot |x - y| \quad \text{für alle } x, y \in [0, 1].$$

Das letzte Beispiel können wir sofort verallgemeinern. Ist die Funktion $f : [a, b] \rightarrow [a, b]$ in dem Intervall $[a, b]$ differenzierbar und gibt es eine Zahl $q < 1$, so dass

$$\forall t \in [a, b] : |f'(t)| \leq q$$

gilt, dann ist die Abbildung f kontrahierend mit dem Kontraktions-Koeffizienten q .

Satz 65 Ist $f : [a, b] \rightarrow [a, b]$ eine kontrahierende Abbildung, so ist f auch stetig.

Aufgabe 30: Beweisen Sie den letzten Satz.

Satz 66 (Banach'scher Fixpunkt-Satz) Es sei $f : [a, b] \rightarrow [a, b]$ eine kontrahierende Abbildung mit dem Kontraktions-Koeffizienten q und x_0 sei eine Zahl aus dem Intervall. Definieren wir die Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ induktiv durch

$$x_{n+1} = f(x_n),$$

so konvergiert diese Folge. Setzen wir

$$\bar{x} := \lim_{n \rightarrow \infty} x_n,$$

so gilt $f(\bar{x}) = \bar{x}$ und darüber hinaus gilt die Abschätzung

$$|x_n - \bar{x}| \leq \frac{q^n}{1 - q} \cdot |x_1 - x_0|.$$

Beweis: Wir starten den Beweis mit einer im ersten Moment skurril anmutenden Formel:

$$x_n - x_0 = (x_n - x_{n-1}) + (x_{n-1} - x_{n-2}) + \dots + (x_2 - x_1) + (x_1 - x_0) = \sum_{i=1}^n (x_i - x_{i-1}).$$

Diese Summe wird als *Teleskop-Summe* bezeichnet. Daraus folgt sofort

$$x_n = x_0 + \sum_{i=1}^n (x_i - x_{i-1}).$$

Damit gilt dann aber

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = x_0 + \sum_{i=1}^{\infty} (x_i - x_{i-1}).$$

Diese Reihe konvergiert, denn wir zeigen, dass die geometrische Reihe eine Majorante ist. Konkret zeigen wir durch Induktion, dass für alle $i \in \mathbb{N}$

$$|x_{i+1} - x_i| \leq q^i \cdot |x_1 - x_0|$$

gilt. Der Induktions-Anfang ist trivial. Im Induktions-Schritt haben wir

$$|x_{i+2} - x_{i+1}| = |f(x_{i+1}) - f(x_i)| \leq q \cdot |x_{i+1} - x_i| \stackrel{IV}{\leq} q \cdot q^i \cdot |x_1 - x_0| = q^{i+1} \cdot |x_1 - x_0|.$$

Nachdem wir jetzt wissen, dass die Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ konvergiert, zeigen wir, dass der Grenzwert \bar{x} ein Fixpunkt der Funktion f ist. Da f als kontrahierende Abbildung auch stetig ist haben wir

$$f(\bar{x}) = f\left(\lim_{n \rightarrow \infty} x_n\right) = \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} x_{n+1} = \lim_{n \rightarrow \infty} x_n = \bar{x}.$$

Den Abstand zwischen \bar{x} und x_n können wir abschätzen, wenn wir \bar{x} als unendliche Reihe schreiben und gleichzeitig x_n durch eine Teleskop-Summe ausdrücken.

$$\begin{aligned} |\bar{x} - x_n| &= \left| x_0 + \sum_{i=1}^{\infty} (x_i - x_{i-1}) - \left(x_0 + \sum_{i=1}^n (x_i - x_{i-1}) \right) \right| \\ &= \left| \sum_{i=n+1}^{\infty} (x_i - x_{i-1}) \right| \leq \sum_{i=n+1}^{\infty} |x_i - x_{i-1}| \\ &= \sum_{i=n}^{\infty} |x_{i+1} - x_i| \leq \sum_{i=n}^{\infty} q^i \cdot |x_1 - x_0| \\ &= |x_1 - x_0| \cdot \sum_{i=n}^{\infty} q^i = |x_1 - x_0| \cdot \sum_{i=0}^{\infty} q^{n+i} \\ &= |x_1 - x_0| \cdot q^n \cdot \sum_{i=0}^{\infty} q^i = |x_1 - x_0| \cdot q^n \cdot \frac{1}{1-q} \end{aligned}$$

Damit haben wir die Abschätzung

$$|\bar{x} - x_n| \leq \frac{q^n}{1-q} \cdot |x_1 - x_0|$$

gezeigt. □

Setzen wir in der eben gezeigten Abschätzung $n = 1$, so erhalten wir

$$|\bar{x} - x_1| \leq \frac{q}{1-q} \cdot |x_1 - x_0|.$$

Wenn wir in dieser Ungleichung x_1 durch x_m und x_0 durch x_{m-1} ersetzen, behält die Ungleichung ihre Gültigkeit, denn wir können x_{m-1} ja als den Startwert einer neuen Folge $(y_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ansehen, für die wir $y_0 = x_{m-1}$ und $y_1 = f(y_0) = f(x_{m-1}) = x_m$ setzen. Wir haben dann also

$$|\bar{x} - x_m| \leq \frac{q}{1-q} \cdot |x_m - x_{m-1}|.$$

Wenn wir q kennen, können wir damit die Güte der bisher erreichten Approximation abschätzen.

Beispiel: Wir haben oben gesehen, dass die Abbildung $\cos : [0, 1] \rightarrow [0, 1]$ kontrahierend ist mit einem Kontraktions-Koeffizienten $q \leq 0.85$. Wollen wir den Fixpunkt dieser Abbildung auf eine Genauigkeit von ε berechnen, so müssen wir folglich solange iterieren, bis

$$\frac{q}{1-q} \cdot |x_m - x_{m-1}| \leq \varepsilon,$$

und das ist äquivalent zu

$$|x_m - x_{m-1}| \leq \frac{1-q}{q} \cdot \varepsilon,$$

Setzen wir hier $q = 0.85$ und $\varepsilon = 10^{-6}$, so ist die Abbruchbedingung also

$$|x_m - x_{m-1}| \leq \frac{1 - 0.85}{0.85} \cdot 10^{-6} \approx 1.77 \cdot 10^{-7}.$$

Wir können auch die Zahl der Iterationen abschätzen, die notwendig sind um den Fixpunkt mit einer Genauigkeit von ε zu berechnen. Wir gehen dazu von der Ungleichung

$$|x_n - \bar{x}| \leq \frac{q^n}{1 - q} \cdot |x_1 - x_0|.$$

aus. Starten wir die Fixpunkt-Iteration mit $x_0 = 0$, so erhalten wir $x_1 = \cos(0) = 1$ und damit können wir die Anzahl der Iterationen n abschätzen:

$$\begin{aligned} & |x_n - \bar{x}| \leq \varepsilon \\ \Leftrightarrow & \frac{q^n}{1 - q} \cdot |x_1 - x_0| \leq \varepsilon \\ \Leftrightarrow & \frac{q^n}{1 - q} \cdot |1 - 0| \leq \varepsilon \\ \Leftrightarrow & \frac{q^n}{1 - q} \leq \varepsilon \\ \Leftrightarrow & n \cdot \ln(q) - \ln(1 - q) \leq \ln(\varepsilon) \\ \Leftrightarrow & n \cdot \ln(q) \leq \ln(\varepsilon) + \ln(1 - q) \\ \Leftrightarrow & n \geq \frac{\ln(\varepsilon) + \ln(1 - q)}{\ln(q)} \\ \Leftrightarrow & n \geq \frac{\ln(10^{-6}) + \ln(1 - 0.85)}{\ln(0.85)} \\ \Leftrightarrow & n \geq \frac{-6 \cdot \ln(10) + \ln(1 - 0.85)}{\ln(0.85)} \\ \Leftrightarrow & n \geq 96.7 \end{aligned}$$

Damit benötigen wir also höchstens 97 Iterationen um die gewünschte Genauigkeit zu erzielen. Wir haben die einzelnen Werte der Folge, die sich bei der iterativen Lösung der Gleichung $x = \cos(x)$ ergibt, in Tabelle 2.1 auf Seite 5 angegeben. Diese Tabelle zeigt, dass bereits nach 36 Iterationen eine Genauigkeit von 10^{-6} erreicht ist. Der Grund dafür, dass es deutlich schneller ging als wir mit der obigen Abschätzung berechnet haben liegt darin, dass der Kontraktions-Koeffizient q den Wert von $\sin(x)$ in dem Intervall $[0, 1]$ abschätzen muss. Da die Sinus-Funktion in diesem Intervall monoton wächst, haben wir den Kontraktions-Koeffizient als $\sin(1) \approx 0.85$ berechnet. Für die Lösung \bar{x} der Fixpunkt-Gleichung gilt aber $\sin(\bar{x}) \approx 0.67$, so dass der Kontraktions-Koeffizient kleiner wird, je mehr wir uns der Lösung annähern.

Aufgabe 31: Lösen Sie für $y = 10^6$ und $y = 10^{-6}$ die Gleichung $x \cdot \exp(x) = y$ durch eine einfache Fixpunkt-Iteration. Berechnen Sie die Lösung x jeweils auf eine Genauigkeit von 10^{-7} .

Auch mit 36 Iterationen ist die Fixpunkt-Iteration bei der Lösung der Gleichung $x = \cos(x)$ dem Bisektions-Verfahren unterlegen. Wir stellen uns daher die Frage, ob wir die Konvergenz der Fixpunkt-Iteration beschleunigen können. Falls die kontrahierende Abbildung f differenzierbar ist, so ist der Kontraktions-Koeffizient durch den Betrag der Ableitung von f gegeben. Wir überlegen uns daher, wie wir die Abbildung so verändern können, dass sich einerseits der Fixpunkt nicht ändert, aber andererseits der Betrag der Ableitung kleiner wird. Dazu formen wir die Fixpunkt-Gleichung $x = f(x)$ wie folgt um:

$$\begin{aligned}
x &= f(x) & | & + \alpha \cdot x \\
\Leftrightarrow (1 + \alpha) \cdot x &= f(x) + \alpha \cdot x & | & \cdot \frac{1}{1 + \alpha} \\
\Leftrightarrow x &= \frac{f(x) + \alpha \cdot x}{1 + \alpha}
\end{aligned}$$

Damit haben wir also die Funktion

$$g(x) = \frac{f(x) + \alpha \cdot x}{1 + \alpha}$$

gefunden, die die selben Fixpunkte hat wie die ursprüngliche Funktion f . Für die Ableitung gilt

$$g'(x) = \frac{f'(x) + \alpha}{1 + \alpha}$$

Der Betrag diese Ableitung wird für den Fixpunkt \bar{x} dann am kleinsten, wenn wir

$$\alpha = -f'(\bar{x})$$

wählen. Wählen wir beispielsweise $\alpha = 0.7$, so finden wir die Lösung der Fixpunkt-Gleichung $x = \cos(x)$ mit dem Programm in Abbildung 4.1 die in Tabelle 4.1 gezeigten Werte. Wir sehen, dass bereits nach fünf Iterations-Schritten eine Genauigkeit von mehr als 10^{-6} erreicht ist.

```

1  x      := 0;
2  alpha := read("input alpha");
3  for (i in [1 .. 12]) {
4      x := 1 / (1 + alpha) * (cos(x) + alpha * x);
5      print("$i$: $x$");
6  }

```

Abbildung 4.1: Berechnung der durch $x_{n+1} = \frac{\cos(x) + \alpha \cdot x_n}{1 + \alpha}$ definierten Folge.

n	x_n	n	x_n
1	0.588235294117647	7	0.739085133207671
2	0.731579943641669	8	0.739085133215044
3	0.738956362842702	9	0.739085133215159
4	0.739083130793540	10	0.739085133215161
5	0.739085102132028	11	0.739085133215161
6	0.739085132732678	12	0.739085133215161

Tabelle 4.1: Die ersten 12 Glieder der durch $x_{n+1} = \frac{\cos(x) + \alpha \cdot x_n}{1 + \alpha}$ definierten Folge für $\alpha = 0.7$.

Das oben skizzierte Verfahren der Konvergenz-Beschleunigung hat einen Schönheitsfehler: Wir haben α so gewählt, dass $f'(\bar{x}) + \alpha$ möglichst klein wird. Das Problem dabei ist, dass wir \bar{x} gar nicht kennen und daher auch $f'(\bar{x})$ unbekannt ist. Eine mögliche Lösung besteht darin, dass wir für α in jedem Schritt $-f'(x_n)$ einsetzen. Das führt auf folgende Definition für die Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$:

$$x_{n+1} = \frac{f(x_n) - f'(x_n) \cdot x_n}{1 - f'(x_n)} \quad (4.36)$$

Abbildung 4.2 zeigt ein Programm zur Umsetzung dieser Idee. Hier haben wir die ersten 7 Werte mit Gleichung (4.36) berechnet, die für den Fall $f(x) = \cos(x)$ die Form

$$x_{n+1} := \frac{\cos(x) + \sin(x) * x}{1 + \sin(x)}$$

annimmt. Da diese Gleichung aber erheblich komplexer ist als die ursprüngliche Gleichung $x_{n+1} = \cos(x_n)$ müssen wir damit rechnen, dass die Rundungsfehler höher sind als bei der Iteration. Zur Eliminierung dieser Rundungsfehler führen wir daher in den Zeilen 8 – 11 noch eine Nach-Iteration mit der Gleichung $x_{n+1} = \cos(x_n)$ durch. Tabelle 4.2 zeigt die von diesem Programm berechneten Werte. Diesmal ist die Genauigkeit von 10^{-6} bereits nach 4 Schritten erreicht, de facto ist der im vierten Schritt berechnete Wert sogar auf 9 Stellen hinter dem Komma genau. Weiter sehen Sie, dass durch die Nach-Iteration die letzte angezeigte verändert wird.

```

1  x := 0;
2  n := 7;
3  for (i in [1 .. 7]) {
4      alpha := -sin(x);
5      x := (cos(x) - alpha * x) / (1 - alpha);
6      print("$i$: $x$");
7  }
8  for (i in [n+1 .. n+4]) {
9      x := cos(x);
10     print("$i$: $x$");
11 }

```

Abbildung 4.2: Berechnung der durch $x_{n+1} = \frac{\cos(x_n) + \sin(x_n) \cdot x}{1 + \sin(x_n)}$ definierten Folge.

n	x_n	n	x_n
1	1.0	7	0.7390851332151608
2	0.7503638678402440	8	0.7390851332151606
3	0.7391128909113617	9	0.7390851332151607
4	0.7390851333852842	10	0.7390851332151607
5	0.7390851332151604	11	0.7390851332151607
6	0.7390851332151608		

Tabelle 4.2: Ausgabe des in Abbildung 4.2 gezeigten Programms.

4.3.1 Das Newton'sche Verfahren zur Berechnung von Nullstellen

Oft besteht die Aufgabe darin, eine Nullstelle einer Funktion $g(x)$ zu finden. Dieses Problem ist dazu äquivalent, eine Fixpunkt-Gleichung zu lösen, denn es gilt

$$g(x) = 0 \Leftrightarrow x + g(x) = x.$$

Eine Nullstelle der Funktion $g(x)$ ist also ein Fixpunkt der Funktion $f(x) = x + g(x)$. Setzen wir in Gleichung (4.36) für $f(x)$ die Funktion $x + g(x)$ ein, so erhalten wir wegen

$$\frac{d}{dx}(x + g(x)) = 1 + g'(x)$$

die Gleichung

$$\begin{aligned}
x_{n+1} &= \frac{x_n + g(x_n) - (1 + g'(x_n)) \cdot x_n}{1 - (1 + g'(x_n))} \\
&= \frac{x_n + g(x_n) - x_n - g'(x_n) \cdot x_n}{-g'(x_n)} \\
&= \frac{-g(x_n) + g'(x_n) \cdot x_n}{g'(x_n)} \\
&= x_n - \frac{g(x_n)}{g'(x_n)}
\end{aligned}$$

Wir haben also die Iterations-Vorschrift

$$x_{n+1} = x_n - \frac{g(x_n)}{g'(x_n)} \quad (4.37)$$

gefunden. Dieses Verfahren wird als *Newton'sches Verfahren* bezeichnet. Die Gleichung (4.37) lässt sich geometrisch interpretieren: Legen wir im Punkt $\langle x_n, g(x_n) \rangle$ eine Tangente an die Funktion g , so schneidet diese Tangente die x -Achse im Punkt

$$x_n - \frac{g(x_n)}{g'(x_n)}.$$

Der neue Wert x_{n+1} ist also die Näherung, die wir erhalten, wenn wir die Funktion g durch die Tangente im Punkt $\langle x_n, g(x_n) \rangle$ ersetzen und dann die Nullstelle berechnen, die diese Tangente hat.

Aufgabe 32: Beweisen Sie diese Behauptung.

Beispiel: Als Anwendung des Newton'schen Verfahrens betrachten wir die Berechnung der k -ten Wurzel ($k \in \mathbb{N}$ mit $k \geq 2$) einer gegebenen Zahl $a > 0$. Wegen

$$x = \sqrt[k]{a} \Leftrightarrow x^k - a = 0$$

setzen wir $g(x) := x^k - a$ und bestimmen die Nullstellen der Funktion $g(x)$ mit dem Newton'schen Verfahren. Für die Ableitung der Funktion $g(x)$ finden wir

$$g'(x) = k \cdot x^{k-1}.$$

Damit lautet die Iterations-Vorschrift

$$x_{n+1} = x_n - \frac{x_n^k - a}{k \cdot x_n^{k-1}} = \frac{1}{k} \left((k-1) \cdot x_n + \frac{a}{x_n^{k-1}} \right).$$

Berechnen wir mit diesem Verfahren die dritte Wurzel aus 2, so lautet die Iterations-Vorschrift

$$x_{n+1} = \frac{1}{3} \cdot \left(2 \cdot x_n + \frac{2}{x_n^2} \right)$$

Lassen wir die Folge mit 1 starten so finden wir die Werte

$$1.0, 1.333333333, 1.263888889, 1.259933494, 1.259921050$$

und der letzte Wert stimmt im Rahmen der Rechengenauigkeit mit $\sqrt[3]{2}$ überein.

Das Newton'sche Verfahren ist nicht robust, denn im Allgemeinen konvergiert das Verfahren nicht. Als Beispiel betrachten wir die Funktion

$$g(x) = x^3 - 2 \cdot x + 2.$$

Es gilt $g(-2) = -8 - 2 \cdot (-2) + 2 = -2 < 0$ und $g(2) = 8 - 2 \cdot 2 + 2 = 6 > 0$. Nach dem Zwischenwert-Satz über stetige Funktionen muss die Funktion g daher in dem Intervall $[-2, 2]$ eine Nullstelle haben. Das Newton'sche Verfahren ergibt die Formel

$$x_{n+1} = x_n - \frac{x_n^3 - 2 \cdot x_n + 2}{3 \cdot x_n^2 - 2}.$$

Wählen wir als Start-Wert $x_0 := 0$, so erhalten wir

$$x_1 = 0 - \frac{2}{-2} = 1.$$

Für x_2 finden wir

$$x_2 = 1 - \frac{1 - 2 + 2}{3 - 2} = 1 - 1 = 0 = x_0.$$

Wir sind also wieder bei unserem Start-Wert angekommen! Damit gilt allgemein

$$x_n = \begin{cases} 0 & \text{falls } n \% 2 = 0, \\ 1 & \text{falls } n \% 2 = 1. \end{cases}$$

Folglich konvergiert das Verfahren in diesem Fall nicht. Wählen wir den Startwert $x_0 = -0.5$, so konvergiert das Verfahren gegen die Lösung $-2.23070764576 \dots$, die außerhalb des Intervalls $[-2, 2]$ liegt. Wählen wir als Startwert $x_0 = -1.5$, so konvergiert das Verfahren gegen die Lösung $-1.769292354238631 \dots$. Diese Beispiele zeigen, dass das Newton'sche Verfahren ohne weitere Einschränkungen nicht robust ist.

4.3.2 Analyse des Newton'schen Verfahrens

Wir wollen in diesem Abschnitt herausfinden, unter welchen Umständen das Newton'sche Verfahren konvergiert und wollen außerdem die Geschwindigkeit der Konvergenz des Verfahrens untersuchen. Als erstes benötigen wir einen Hilfssatz über konvexe Funktionen.

Lemma 67 Die Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ sei zweimal differenzierbar und konvex. Ist $x_0 \in [a, b]$ und definieren wir die lineare Funktion $g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ als

$$g(x) := f(x_0) + f'(x_0) \cdot (x - x_0),$$

so ist die Funktion g die Tangente an f im Punkt $\langle x_0, f(x_0) \rangle$ und es gilt

$$g(x) \leq f(x) \quad \text{für alle } x \in [a, b].$$

Anschaulich bedeutet dies, dass die Tangente immer unterhalb einer konvexen Funktion liegt.

Beweis: Zunächst gilt offenbar

$$g(x_0) = f(x_0) + f'(x_0) \cdot (x_0 - x_0) = f(x_0),$$

so dass die Werte der Funktionen f und g im Punkt x_0 übereinstimmen. Für die Ableitung von $g(x)$ finden wir

$$g'(x) = f'(x_0),$$

so dass die Gerade g die selbe Steigung hat wie die Funktion f an der Stelle x_0 . Damit ist g aber die Tangente an die Funktion f an der Stelle x_0 . Zum Beweis der Ungleichung $g(x) \leq f(x)$ definieren wir die Funktion $h : [a - x_0, b - x_0] \rightarrow \mathbb{R}$ als

$$h(x) := f(x + x_0).$$

Nach Gleichung (4.17) gilt für die Funktion h die Gleichung

$$h(x) = h(0) + h'(0) \cdot x + \frac{1}{2} \cdot h^{(2)}(\chi) \cdot x^2,$$

wobei χ ein Element des Intervalls $[a - x_0, b - x_0]$ ist, über das wir sonst nichts wissen. Aufgrund der Gleichungen

$$f(x) = h(x - x_0), \quad h(0) = f(x_0), \quad h'(0) = f'(x_0) \quad \text{und} \quad h^{(2)}(\chi) = f^{(2)}(\chi + x_0),$$

folgt daraus für die Funktion f die Gleichung

$$f(x) = f(x_0) + f'(x_0) \cdot (x - x_0) + \frac{1}{2} \cdot f^{(2)}(\chi + x_0) \cdot (x - x_0)^2.$$

Definieren wir $\varphi := \chi + x_0$, so gilt $\varphi \in [a, b]$ und wir haben

$$\begin{aligned} f(x) &= f(x_0) + f'(x_0) \cdot (x - x_0) + \frac{1}{2} \cdot f^{(2)}(\varphi) \cdot (x - x_0)^2 \\ &= g(x) + \frac{1}{2} \cdot f^{(2)}(\varphi) \cdot (x - x_0)^2 \\ &\geq g(x), \end{aligned}$$

denn da wir angenommen hatten, dass die Funktion f zweimal differenzierbar und konvex ist, gilt

$$f^{(2)}(\varphi) \geq 0$$

und das Quadrat $(x - x_0)^2$ ist sicher immer größer oder gleich 0. \square

Satz 68 Die Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ sei zweimal differenzierbar und konvex, es gelte $f(a) < 0$, $f(b) > 0$ und

$$\forall x \in [a, b] : f'(x) > 0.$$

Falls der Startwert $x_0 \in [a, b]$ so gewählt wird, dass $f(x_0) > 0$ ist, dann ist die durch das Newton'sche Verfahren definierte Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ monoton fallend und beschränkt und damit konvergent. Für den Grenzwert

$$\bar{x} := \lim_{n \rightarrow \infty} x_n$$

gilt $f(\bar{x}) = 0$.

Beweis: Nach dem Zwischenwert-Satz hat die Funktion eine Nullstelle ξ in dem Intervall $[a, b]$. Da $f'(x)$ für alle $x \in [a, b]$ echt größer als Null ist, kann f keine zweite Nullstelle haben, denn sonst hätten wir einen Widerspruch zum Satz von Rolle. Also gilt

$$\forall x \in [a, \xi) : f(x) < 0 \quad \text{und} \quad \forall x \in (\xi, b] : f(x) > 0.$$

Wir zeigen zunächst durch Induktion über n , dass

$$f(x_n) \geq 0 \quad \text{für alle } n \in \mathbb{N} \text{ gilt.}$$

I.A. $n = 0$.

Die Ungleichung $f(x_0) > 0$ gilt nach Voraussetzung.

I.S. $n \mapsto n + 1$.

Nach der Definition ist x_{n+1} die Nullstelle der Tangente g an die Funktion f im Punkt x_n , es gilt also $g(x_{n+1}) = 0$. Die Tangente g hat nach dem letzten Lemma die Form

$$g(x) = f(x_n) + f'(x_n) \cdot (x - x_n)$$

und ebenfalls nach dem letzten Lemma gilt $g(x) \leq f(x)$. Da nun $g(x_{n+1}) = 0$ ist, folgt aus der Ungleichung $g(x) \leq f(x)$ durch Einsetzen von x_{n+1} die Ungleichung

$$0 \leq f(x_{n+1}).$$

Nach Definition von x_{n+1} gilt

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)}.$$

Einerseits haben wir gerade gezeigt, dass $f(x_n) \geq 0$ ist, andererseits ist die Voraussetzung, dass für alle $x \in [a, b]$ die Ungleichung $f'(x) > 0$ gilt. Daraus folgt aber

$$\frac{f(x_n)}{f'(x_n)} \geq 0$$

und damit gilt

$$x_{n+1} \leq x_n.$$

Dies zeigt, dass die Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ monoton fallend ist. Da wir andererseits wissen, dass $f(x_n) \geq 0$ ist, muss $x_n \geq \xi$ gelten. Also ist die Folge x_n nach unten beschränkt. Als monoton fallend und beschränkte Folge hat $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ damit einen Grenzwert \bar{x} . Für diesen Grenzwert gilt dann

$$\begin{aligned}\bar{x} &= \lim_{n \rightarrow \infty} x_n \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} x_{n+1} \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)} \\ &= \bar{x} - \frac{f(\bar{x})}{f'(\bar{x})}\end{aligned}$$

Aus der Gleichung

$$\bar{x} = \bar{x} - \frac{f(\bar{x})}{f'(\bar{x})} \quad \text{folgt sofort} \quad 0 = -\frac{f(\bar{x})}{f'(\bar{x})}$$

und daraus folgt durch Multiplikation mit $-f'(\bar{x})$ die gesuchte Gleichung $f(\bar{x}) = 0$.

Benutzen wir das Newton'sche Verfahren zur Berechnung von $\sqrt{2}$, so erhalten wir die folgenden Ergebnisse:

[illegible]

Wir sehen, dass x_2 auf 2 Stellen hinter dem Komma mit $\sqrt{2}$ übereinstimmt, bei x_3 sind bereits 5 Stellen richtig, x_4 hat eine Genauigkeit von 11 Stellen, x_5 stimmt auf 24 Stellen mit $\sqrt{2}$ überein, bei x_6 sind es 48 Stellen und x_7 hat bereits eine Genauigkeit von 100 Stellen. Wir beobachten, dass sich die Zahl der korrekten Stellen mit jeder Operation etwa verdoppelt. Diese Phänomene wollen wir nun genauer untersuchen. Dazu entwickeln wir die Funktion $f(x)$ an der Stelle x_n in einer Taylor-Reihe, die wir nach dem linearen Glied abbrechen. Wir erhalten

$$f(x) = f(x_n) + f'(x_n) \cdot (x - x_n) + \frac{1}{2} \cdot f^{(2)}(\varphi) \cdot (x - x_n)^2$$

Hier setzen wir für x den Wert \bar{x} , also die Nullstelle ein und erhalten

$$0 = f(x_n) + f'(x_n) \cdot (\bar{x} - x_n) + \frac{1}{2} \cdot f^{(2)}(\varphi) \cdot (\bar{x} - x_n)^2$$

Hier subtrahieren wir $f(x_n)$ und teilen anschließend durch $f'(x_n)$. Das liefert die Gleichung

$$-\frac{f(x_n)}{f'(x_n)} = \bar{x} - x_n + \frac{1}{2} \cdot \frac{f^{(2)}(\varphi)}{f'(x_n)} \cdot (\bar{x} - x_n)^2$$

Jetzt addieren wir x_n und subtrahieren \bar{x} . Das liefert

$$x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)} - \bar{x} = \frac{1}{2} \cdot \frac{f^{(2)}(\varphi)}{f'(x_n)} \cdot (\bar{x} - x_n)^2.$$

An dieser Stelle bemerken wir, dass $x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)} = x_{n+1}$ ist und haben dann

$$x_{n+1} - \bar{x} = \frac{1}{2} \cdot \frac{f^{(2)}(\varphi)}{f'(x_n)} \cdot (\bar{x} - x_n)^2.$$

Wir definieren nun $\varepsilon_n := |x_n - \bar{x}|$. Der Wert ε gibt also den Betrag des Approximations-Fehler an, den wir nach der n -ten Iteration des Newton'schen Verfahrens haben. Damit schreibt sich die letzte Gleichung als

$$\varepsilon_{n+1} = \frac{1}{2} \cdot \left| \frac{f^{(2)}(\varphi)}{f'(x_n)} \right| \cdot \varepsilon_n^2.$$

In den Fällen, in denen wir den Ausdruck $\frac{1}{2} \cdot \left| \frac{f^{(2)}(\varphi)}{f'(x_n)} \right|$ durch eine Konstante K abschätzen können, haben wir dann

$$\varepsilon_{n+1} \leq K \cdot \varepsilon_n^2.$$

Die Zahl der korrekten Stellen nach der n -ten Iteration ist in etwa durch

$$\lambda_n \approx -\log_{10}(\varepsilon_n)$$

gegeben. Logarithmieren wir die obige Gleichung zur Basis 10, so erhalten wir

$$\lambda_{n+1} \geq 2 \cdot \lambda_n - \log_{10}(K).$$

Zur Konkretisierung unserer Überlegungen betrachten wir wieder die Funktion $f(x) = x^2 - 2$. Hier gilt

$$f'(x) = 2 \cdot x \geq 2 \quad \text{falls } x \geq 1 \text{ ist}$$

und weiter gilt $f^{(2)}(x) = 2$. Damit gilt

$$\frac{1}{2} \cdot \left| \frac{f^{(2)}(\varphi)}{f'(x_n)} \right| \leq \frac{1}{2}$$

und wegen $\log_{10}(\frac{1}{2}) \approx -0.3$ haben wir die Abschätzung

$$\lambda_{n+1} = 2 \cdot \lambda_n + 0.3$$

gefunden, die in der Tat zeigt, dass sich die Anzahl der korrekten Stellen bei jedem Schritt etwa verdoppelt.

Aufgabe 33: Analysieren Sie das Newton'sche Verfahren zur Berechnung der dritten Wurzel aus 2 und berechnen Sie, wieviele Iterationen höchstens notwendig sind um den Wert von $\sqrt[3]{2}$ auf eine Genauigkeit von 10^{-101} zu berechnen.

4.4 Iterative Lösung linearer Gleichungs-Systeme

Es sei eine $n \times n$ Matrix $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{n \times n}$ und ein Vektor $\vec{b} \in \mathbb{R}^n$ gegeben. Eine Möglichkeit, das Gleichungs-System

$$\mathbf{A} \vec{x} = \vec{b}$$

zu lösen, haben Sie im ersten Semester kennegelernt: Es ist das Gauß'sche Eliminations-Verfahren (Carl Friedrich Gauß, 1777 – 1855). Es gibt allerdings Situationen, in denen dieses Verfahren zu aufwendig ist. Dies ist beispielsweise dann der Fall, wenn einerseits n groß ist und wenn andererseits die meisten Komponenten der Matrix A den Wert 0 haben. Solche Matrizen heißen *dünn besetzte* Matrizen. Diese Art von Matrizen tritt bei der numerischen Lösung von Differenzial-Gleichungen auf. Das Gauß'sche Eliminations-Verfahren besitzt eine Komplexität von $O(n^3)$ und ist damit für große dünn besetzte Matrizen ungeeignet. Hier ist der Rechenaufwand bei iterative Verfahren geringer. Ein weiteres Problem ist, dass die Rundungsfehler beim Gauß'schen Eliminations-Verfahren sehr groß werden können. Demgegenüber sind iterative Verfahren selbstkorrigierend.

Ist \mathbf{A} gegeben, so lautet die Gleichung $\mathbf{A} \vec{x} = \vec{b}$ in Komponenten-Schreibweise

$$\sum_{j=1}^n a_{ij} \cdot x_j = b_i \quad \text{für alle } i = 1, \dots, n.$$

Die Idee besteht darin, diese Gleichung in eine Fixpunkt-Gleichung zu transformieren. Dazu formen wir die Gleichung wie folgt um:

$$\begin{aligned} \sum_{j=1}^n a_{ij} \cdot x_j &= b_i \\ \Leftrightarrow a_{ii} \cdot x_i + \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n a_{ij} \cdot x_j &= b_i \\ \Leftrightarrow a_{ii} \cdot x_i &= b_i - \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n a_{ij} \cdot x_j \\ \Leftrightarrow x_i &= \frac{1}{a_{ii}} \cdot \left(b_i - \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n a_{ij} \cdot x_j \right). \end{aligned}$$

Diese Umformung liefert uns die Iterations-Vorschrift

$$x_i^{(n+1)} = \frac{1}{a_{ii}} \cdot \left(b_i - \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n a_{ij} \cdot x_j^{(n)} \right)$$

mit der wir versuchen können, eine Lösung der Fixpunkt-Gleichung zu finden. Das Verfahren, das wir auf diese Weise erhalten, wird als *Gesamtschritt-Verfahren* oder auch als *Jacobi-Verfahren* (Carl Gustav Jacob Jacobi, 1804 – 1851) bezeichnet. Die Frage lautet jetzt, wann die durch dieses Verfahren definierte Iteration konvergiert. Um eine positive Antwort auf diese Frage geben zu können, benötigen wir die folgenden Definitionen.

Definition 69 (Starkes Zeilen-Summen-Kriterium) Eine $n \times n$ Matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ erfüllt das *starke Zeilen-Summen-Kriterium* falls es eine Zahl $q < 1$ gibt, so dass gilt

$$\sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n |a_{ij}| \leq q \cdot |a_{ii}| \quad \text{für alle } i = 1, \dots, n.$$

Falls $a_{ii} \neq 0$ ist, ist die in der obigen Definition gegebene Ungleichung äquivalent zu der Ungleichung

$$\frac{1}{|a_{ii}|} \cdot \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n |a_{ij}| \leq q.$$

Als nächstes führen wir ein Konzept ein, das den Begriff des Betrags auf Vektoren aus dem \mathbb{R}^n verallgemeinert.

Definition 70 (Maximums-Norm) Ist $\vec{x} \in \mathbb{R}^n$, so definieren wir die Maximums-Norm von \vec{x} als

$$\|\vec{x}\|_\infty := \max\{ |x_i| \mid i \in \{1, \dots, n\} \}.$$

Mit der so definierten Norm können wir so rechnen, wie wir das von Beträgen bei reellen Zahlen gewöhnt sind, insbesondere gilt auch die *Dreiecks-Ungleichung*, wir haben also für beliebige Vektoren $\vec{x}, \vec{y} \in \mathbb{R}^n$

$$\|\vec{x} + \vec{y}\|_\infty \leq \|\vec{x}\|_\infty + \|\vec{y}\|_\infty.$$

Außerdem haben wir für reelle Zahlen $\alpha \in \mathbb{R}$ und Vektoren $\vec{x} \in \mathbb{R}^n$ die Gleichung

$$\|\alpha \vec{x}\|_\infty = |\alpha| \cdot \|\vec{x}\|_\infty$$

Hierbei bezeichnet $\alpha \vec{x}$ die komponentenweise Multiplikation des Vektors \vec{x} mit der Zahl α . Schließlich gilt für alle $\vec{x} \in \mathbb{R}^n$ die Ungleichung $0 \leq \|\vec{x}\|_\infty$ wobei Gleichheit nur im Fall $\vec{x} = \vec{0}$ auftritt:

$$\|\vec{x}\|_\infty = 0 \Rightarrow \vec{x} = \vec{0} \quad \text{für alle } \vec{x} \in \mathbb{R}^n.$$

Der folgende Satz beantwortet nun die oben gestellte Frage nach der Konvergenz des Gesamtschritt-Verfahrens in einem für Anwendungen wichtigen Spezial-Fall.

Satz 71 Wenn die Matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ das starke Zeilen-Summen-Kriterium erfüllt, dann konvergiert das Gesamtschritt-Verfahren für jeden Start-Vektor. Bezeichnen wir die Vektoren der Iteration mit $\vec{x}^{(n)}$ und definieren wir

$$\vec{x}^{(\infty)} := \lim_{n \rightarrow \infty} \vec{x}^{(n)}$$

und ist weiter q die Zahl aus dem starken Zeilen-Summen-Kriterium, dann gilt außerdem die Abschätzung

$$\|\vec{x}^{(\infty)} - \vec{x}^{(n)}\|_\infty \leq \frac{q^n}{1 - q} \cdot \|\vec{x}^{(0)} - \vec{x}^{(1)}\|_\infty.$$

Beweis: Wir definieren eine Funktion $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ komponentenweise:

$$f_i(\vec{x}) = \frac{1}{a_{ii}} \cdot \left(b_i - \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n a_{ij} \cdot x_j \right).$$

Die i -te Komponente der Funktion f berechnet also gerade die i -te Komponente des Vektors $\vec{x}^{(n+1)}$. Wir zeigen nun, dass für beliebige Vektoren $\vec{x}, \vec{y} \in \mathbb{R}^n$

$$\|f(\vec{x}) - f(\vec{y})\|_\infty \leq q \cdot \|\vec{x} - \vec{y}\|_\infty$$

gilt, denn dann ist f eine kontrahierende Abbildung, und die Behauptung des Satzes folgt aus dem Banach'schen Fixpunkt-Satz, den wir zwar nur für Funktionen $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ bewiesen haben, der aber auch für vektorwertige Funktionen im \mathbb{R}^n gilt, wenn wir den Betrag durch die Maximums-Norm ersetzen. Wir schätzen die Differenz $|f_i(\vec{x}) - f_i(\vec{y})|$ wie folgt ab:

$$\begin{aligned} |f_i(\vec{x}) - f_i(\vec{y})| &= \left| \frac{1}{a_{ii}} \cdot \left(b_i - \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n a_{ij} \cdot x_j \right) - \frac{1}{a_{ii}} \cdot \left(b_i - \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n a_{ij} \cdot y_j \right) \right| \\ &= \left| \frac{1}{a_{ii}} \cdot \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n a_{ij} \cdot (y_j - x_j) \right| \leq \frac{1}{|a_{ii}|} \cdot \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n |a_{ij}| \cdot |x_j - y_j| \\ &\leq \frac{1}{|a_{ii}|} \cdot \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n |a_{ij}| \cdot \|\vec{x} - \vec{y}\|_\infty \leq \left(\frac{1}{|a_{ii}|} \cdot \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n |a_{ij}| \right) \cdot \|\vec{x} - \vec{y}\|_\infty \\ &\leq q \cdot \|\vec{x} - \vec{y}\|_\infty \end{aligned}$$

Da diese Ungleichung für alle $i = 1, \dots, n$ gilt, haben wir insgesamt die Abschätzung

$$\|f(\vec{x}) - f(\vec{y})\|_{\infty} \leq q \cdot \|\vec{x} - \vec{y}\|_{\infty}$$

gezeigt und die Behauptung folgt nun aus dem Banach'schen Fixpunkt-Satz. \square

Abbildung 4.3 auf Seite 99 zeigt eine einfache Implementierung des Jacobi-Verfahrens. Die Funktion `jacobi()` bekommt drei Argumente:

1. a ist eine $n \times n$ Matrix, die durch eine Liste dargestellt wird, deren Elemente selbst wieder Listen der Länge n sind. Auf das Matrix-Element a_{ij} wird in SETLX dann durch den Ausdruck $a[i][j]$ zugegriffen.
2. b ist eine n -dimensionaler Vektor, der durch eine Liste der Länge n dargestellt wird.
3. k ist die Anzahl der durchzuführenden Iterationen.

```

1  jacobi := procedure(a, b, k) {
2      n := #b;
3      assert(#a == n, "wrong number of equations");
4      assert(#a[1] == n, "wrong number of variables");
5      x := xNew := [ 0 : i in [ 1 .. n ] ];
6      for (l in [1 .. k]) {
7          for (i in [1 .. n]) {
8              xNew[i] := b[i];
9              for (j in [ 1 .. n ]) {
10                 if (i != j) {
11                     xNew[i] -= a[i][j] * x[j];
12                 }
13             }
14             xNew[i] /= a[i][i];
15         }
16         x := xNew;
17         print("$l$: $x$");
18     }
19     return x;
20 };
21
22 demo := procedure() {
23     a := [ [ 4.0, 1.0, 0.0 ],
24            [ 1.0, 4.0, 1.0 ],
25            [ 0.0, 1.0, 4.0 ] ];
26     b := [ 5.0, 6.0, 5.0 ];
27     k := 35;
28     x := jacobi(a, b, k);
29     print("x = $x$");
30 };

```

Abbildung 4.3: Implementierung des Jacobi-Verfahrens.

Die Funktion `jacobi(a, b, x)` versucht, mit Hilfe des Jacobi-Verfahrens das lineare Gleichungssystem

$$\mathbf{a} \vec{x} = \vec{b}$$

zu lösen und arbeitet im Detail wie folgt:

1. In Zeile 5 wird der Start-Vektor $\vec{x}^{(0)}$ als Null-Vektor definiert. Die Variable `xNew` speichert den Wert $\vec{x}^{(n+1)}$.
2. Die Schleife, die in Zeile 6 beginnt, führt insgesamt k Iterationen des Jacobi-Verfahrens aus.
3. Die Schleife, die in Zeile 7 beginnt, berechnet den nächsten Wert $\vec{x}^{(n+1)}$ gemäß der Formel

$$x_i^{(n+1)} = \frac{1}{a_{ii}} \cdot \left(b_i - \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n a_{i,j} \cdot x_j \right).$$

Der Index i läuft dabei über die Komponenten des Vektors $\vec{x}^{(n+1)}$.

Die Funktion `demo()` ruft die Funktion so auf, dass anschließend das Gleichungs-System

$$\begin{pmatrix} 4.0 & 1.0 & 0.0 \\ 1.0 & 4.0 & 1.0 \\ 0.0 & 1.0 & 4.0 \end{pmatrix} \vec{x} = \begin{pmatrix} 5.0 \\ 6.0 \\ 5.0 \end{pmatrix}$$

gelöst werden kann. Die Lösung dieses Systems ist

$$\vec{x} = \begin{pmatrix} 1.0 \\ 1.0 \\ 1.0 \end{pmatrix}.$$

Diese Lösung wird nach 35 Iterationen gefunden. Tabelle 4.3 auf Seite 101 zeigt den Verlauf der Rechnung. Die Matrix A erfüllt das starke Zeilen-Summen-Kriterium mit $q = \frac{1}{2}$. Die exakte Lösung wird nach 35 Schritten gefunden.

Das Gauß-Seidel-Verfahren

Betrachten wir die Implementierung des Gesamtschritt-Verfahrens, so liegt die folgende Optimierung auf der Hand. Wenn wir mit der Formel

$$x_i^{(n+1)} = \frac{1}{a_{ii}} \cdot \left(b_i - \sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n a_{ij} \cdot x_j^{(n)} \right)$$

die i -te Komponente von $\vec{x}^{(n+1)}$ berechnen, dann kennen wir bereits die neuen Komponenten $x_1^{(n+1)}, \dots, x_{i-1}^{(n+1)}$. Da diese Komponenten (hoffentlich) näher an der Lösung liegen als die Komponenten $x_1^{(n)}, \dots, x_{i-1}^{(n)}$ des alten Vektors $\vec{x}^{(n)}$, liegt es nahe, für $j < i$ die neuen Komponenten $x_j^{(n+1)}$ an Stelle der alten Komponenten $x_j^{(n)}$ zu benutzen. Damit kommen wir zu der zunächst kompliziert aussehenden Iterations-Formel

$$x_i^{(n+1)} = \frac{1}{a_{ii}} \cdot \left(b_i - \sum_{j=1}^{i-1} a_{ij} \cdot x_j^{(n+1)} - \sum_{j=i+1}^n a_{ij} \cdot x_j^{(n)} \right).$$

Das Verfahren, das auf dieser Formel basiert, wird als *Einzelsschritt-Verfahren* oder auch *Gauß-Seidel-Verfahren* (Philipp Ludwig von Seidel, 1821 – 1896) bezeichnet.

Abbildung 4.4 zeigt, wie wir die Implementierung ändern müssen, wenn wir das Gauß-Seidel-Verfahren anwenden wollen. Die Implementierung des Gauß-Seidel-Verfahrens ist einfacher als die Implementierung des Jacobi-Verfahrens, denn wir benötigen keine Hilfsvariable `xNew` mehr. Tabelle 4.4 zeigt, dass das Gauß-Seidel-Verfahren für unser Beispiel etwa doppelt so schnell konvergiert wie das Jacobi-Verfahren. Es lässt sich zeigen, dass das Gauß-Seidel-Verfahren zur Lösung immer dann konvergiert, wenn die Matrix A des linearen Gleichungs-Systems

$$A\vec{x} = \vec{b}$$

das starke Zeilen-Summen-Kriterium erfüllt. Allerdings ist die theoretische Analyse des Gauß-Seidel-Verfahrens schwieriger als die Untersuchung des Jacobi-Verfahrens, so dass wir von einer detaillierteren Diskussion aus Zeitgründen absehen müssen.

n	$x_1^{(n)}$	$x_2^{(n)}$	$x_3^{(n)}$
1	1.25	1.5	1.25
2	0.875	0.875	0.875
3	1.03125	1.0625	1.03125
4	0.984375	0.984375	0.984375
5	1.00390625	1.0078125	1.00390625
6	0.998046875	0.998046875	0.998046875
7	1.00048828125	1.0009765625	1.00048828125
8	0.999755859375	0.999755859375	0.999755859375
9	1.00006103515625	1.0001220703125	1.00006103515625
10	0.999969482421875	0.999969482421875	0.999969482421875
11	1.0000076293945312	1.0000152587890625	1.0000076293945312
12	0.9999961853027344	0.9999961853027344	0.9999961853027344
13	1.0000009536743164	1.0000019073486328	1.0000009536743164
14	0.9999995231628418	0.9999995231628418	0.9999995231628418
15	1.0000001192092896	1.000000238418579	1.0000001192092896
16	0.9999999403953552	0.9999999403953552	0.9999999403953552
17	1.0000000149011612	1.0000000298023224	1.0000000149011612
18	0.9999999925494194	0.9999999925494194	0.9999999925494194
19	1.0000000018626451	1.0000000037252903	1.0000000018626451
20	0.9999999990686774	0.9999999990686774	0.9999999990686774
21	1.0000000002328306	1.0000000004656613	1.0000000002328306
22	0.9999999998835847	0.9999999998835847	0.9999999998835847
23	1.0000000000291038	1.0000000000582077	1.0000000000291038
24	0.9999999999854481	0.9999999999854481	0.9999999999854481
25	1.000000000003638	1.000000000007276	1.000000000003638
26	0.999999999998181	0.999999999998181	0.999999999998181
27	1.0000000000004547	1.0000000000009095	1.0000000000004547
28	0.999999999997726	0.999999999997726	0.999999999997726
29	1.000000000000568	1.0000000000001137	1.000000000000568
30	0.999999999999716	0.999999999999716	0.999999999999716
31	1.000000000000007	1.0000000000000142	1.000000000000007
32	0.999999999999964	0.999999999999964	0.999999999999964
33	1.000000000000009	1.0000000000000018	1.000000000000009
34	0.999999999999996	0.999999999999996	0.999999999999996
35	1.0	1.0	1.0

Tabelle 4.3: Konvergenz des Jacobi-Verfahrens.

```

1  gaussSeidel := procedure(a, b, k) {
2      n := #b;
3      assert(#a == n, "wrong number of equations");
4      assert(#a[1] == n, "wrong number of variables");
5      x := [ 0 : i in [ 1 .. n ] ];
6      for (l in [1 .. k]) {
7          for (i in [1 .. n]) {
8              x[i] := b[i];
9              for (j in [ 1 .. n ]) {
10                 if (i != j) {
11                     x[i] -= a[i][j] * x[j];
12                 }
13             }
14             x[i] /= a[i][i];
15         }
16         print("$l$: $x$");
17     }
18     return x;
19 };

```

Abbildung 4.4: Implementierung des Gauß-Seidel-Verfahrens.

n	$x_1^{(n)}$	$x_2^{(n)}$	$x_3^{(n)}$
1	1.25	1.1875	0.953125
2	0.953125	1.0234375	0.994140625
3	0.994140625	1.0029296875	0.999267578125
4	0.999267578125	1.0003662109375	0.999908447265625
5	0.999908447265625	1.0000457763671875	0.9999885559082031
6	0.9999885559082031	1.0000057220458984	0.9999985694885254
7	0.9999985694885254	1.0000007152557373	0.9999998211860657
8	0.9999998211860657	1.0000000894069672	0.9999999776482582
9	0.9999999776482582	1.000000011175871	0.9999999972060323
10	0.9999999972060323	1.0000000013969839	0.999999999650754
11	0.999999999650754	1.000000000174623	0.9999999999563443
12	0.9999999999563443	1.0000000000218279	0.999999999994543
13	0.999999999994543	1.0000000000027285	0.9999999999993179
14	0.9999999999993179	1.000000000000341	0.9999999999999147
15	0.9999999999999147	1.0000000000000426	0.9999999999999893
16	0.9999999999999893	1.0000000000000053	0.9999999999999987
17	0.9999999999999987	1.0000000000000009	0.9999999999999998
18	0.9999999999999998	1.0	1.0
19	1.0	1.0	1.0

Tabelle 4.4: Konvergenz des Gauß-Seidel-Verfahrens.

Kapitel 5

Integral-Rechnung

5.1 Einführung des Integral-Begriffs

In diesem Kapitel beschäftigen wir uns mit der Frage, wie die Fläche unter einer Kurve berechnet werden kann. Um die Dinge konkret zu machen betrachten wir die Funktion $x \mapsto x^2$ und fragen, welche Fläche von dieser Kurve und der x -Achse im Intervall $[0, 1]$ eingeschlossen wird. Diese Fläche ist in Abbildung 5.1 grau dargestellt.

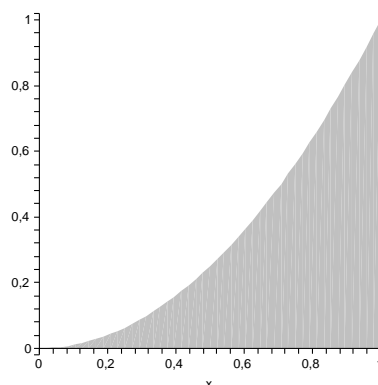


Abbildung 5.1: Die Fläche unter der Parabel $x \mapsto x^2$ im Intervall $[0, 1]$.

Wir können versuchen, diese Fläche durch sogenannte *Treppen-Funktionen* zu approximieren. Eine Treppen-Funktion ist eine Funktion, die stückweise konstant ist. Abbildung 5.2 auf Seite 104 zeigt eine Approximation der Funktion $x \mapsto x^2$ durch eine Treppen-Funktion. In dieser Abbildung haben wir das Intervall $[0, 1]$ in 10 gleich große Teilintervalle aufgeteilt. Wollen wir im allgemeinen Fall die Fläche unter eine Funktion f in einem vorgegebenen Intervall $[a, b]$ berechnen, so unterteilen wir das Intervall $[a, b]$ in n Teilintervalle der Form

$$[a + (i - 1) \cdot h, a + i \cdot h] \quad \text{mit } h := \frac{b - a}{n} \text{ und } i = 1, \dots, n.$$

Um dann die Fläche berechnen zu können, approximieren wir diese Fläche zum einen durch einer Treppen-Funktion, die oberhalb der Funktion liegt und zum anderen durch eine Treppen-Funktion, die unterhalb von der Funktion liegt. Wir nehmen zur Vereinfachung zunächst an, dass die Funktion f monoton steigend ist. In diesem Fall definieren wir zu einer vorgegebenen Zahl n von Intervallen die obere Treppen-Funktion $f_n^\uparrow(x)$ wie folgt:

$$f_n^\uparrow(x) := f(a + i \cdot h) \quad \text{falls } x \in]a + (i - 1) \cdot h, a + i \cdot h[\text{ und } i = 1, \dots, n. \quad (5.1)$$

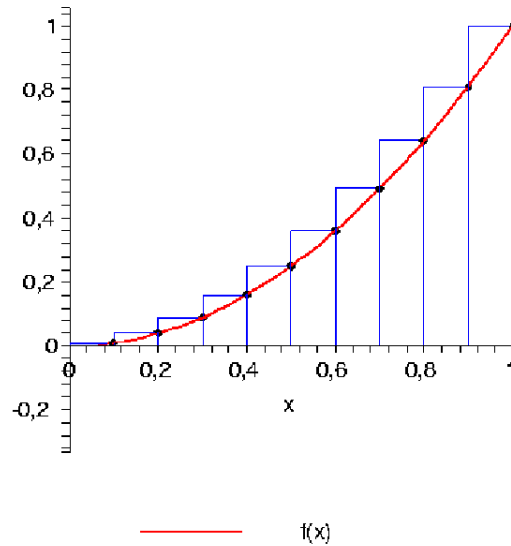


Abbildung 5.2: Die Fläche unter der Parabel $x \mapsto x^2$ im Intervall $[0, 1]$.

Da wir f als monoton steigend vorausgesetzt haben, gilt

$$\forall x \in]a + (i - 1) \cdot h, a + i \cdot h[: f(x) \leq f(a + i \cdot h) = f^\downarrow(x),$$

die Funktion f liegt also unterhalb der Treppen-Funktion f^\downarrow . Wie die Treppen-Funktion an den Randpunkten der Intervalle $[a + (i - 1) \cdot h, a + i \cdot h]$ definiert wird, ist unwichtig. Abbildung 5.2 zeigt die Funktion $f(x) = x^2$ und die zugehörige Treppen-Funktion $f_{10}^\downarrow(x)$. Die Fläche unter einer solchen Treppen-Funktion kann leicht berechnet werden: Schreiben wir

$$\int_a^b f(x) dx$$

für die Fläche unter einer Funktion f in dem Intervall $[a, b]$, so gilt für die Treppen-Funktion f_n^\downarrow offenbar

$$\int_a^b f_n^\downarrow(x) dx = \sum_{i=1}^n f(a + i \cdot h) \cdot h \quad (5.2)$$

denn die Fläche eines Rechtecks berechnet sich als das Produkt von Breite und Höhe. Die Höhe des Rechtecks im i -ten Teilintervall hat den Wert $f(a + i \cdot h)$ und die Breite des Teilintervalls ist h .

Genau wie wir die Fläche unter der Funktion f von oben approximieren können, können wir diese Fläche auch von unten approximieren. Die dazu notwendige Treppen-Funktion $f_n^\uparrow(x)$ definieren wir analog zu Gleichung (5.1)

$$f_n^\uparrow(x) = f(a + (i - 1) \cdot h) \quad \text{falls } x \in]a + (i - 1) \cdot h, a + i \cdot h[, \quad (5.3)$$

wir werten also diesmal in jedem Intervall die Funktion f am linken Eckpunkt aus. Da die Funktion f monoton steigend ist, ist dann klar, dass die Funktion f^\uparrow unterhalb der Funktion f liegt. Für

diese Treppen-Funktion berechnet sich die Fläche also nach der Formel

$$\int_a^b f_n^\uparrow(x) dx = \sum_{i=1}^n f(a + (i-1) \cdot h) \cdot hw = \sum_{i=0}^{n-1} f(a + i \cdot h) \cdot h. \quad (5.4)$$

Für die Fläche, die zwischen der Funktion f und der x -Achse liegt, haben wir insgesamt die Abschätzung

$$\sum_{i=0}^{n-1} f(a + i \cdot h) \cdot h \leq \int_a^b f(x) dx \leq \sum_{i=1}^n f(a + i \cdot h) \cdot h$$

gefunden. Die linke Summe bezeichnen wir als *Unter-Summe*, die Summe auf der rechten Seite der Ungleichungskette nennen wir *Ober-Summe*. Wir können hoffen, dass für wachsende Werte von n die Werte von Ober-Summe und Unter-Summe gegen den selben Grenzwert konvergieren. Dazu berechnen wir zunächst die Differenz dieser beiden Summen:

$$\begin{aligned} & \sum_{i=1}^n f(a + i \cdot h) \cdot h - \sum_{i=0}^{n-1} f(a + i \cdot h) \cdot h \\ &= f(a + n \cdot h) \cdot h - f(a) \cdot h \\ &= \left(f\left(a + n \cdot \frac{b-a}{n}\right) - f(a) \right) \cdot \frac{b-a}{n} \\ &= \left(f(a + b - a) - f(a) \right) \cdot \frac{b-a}{n} \\ &= \left(f(b) - f(a) \right) \cdot \frac{b-a}{n} \\ &\xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0 \end{aligned}$$

Damit ist klar, dass bei einer monoton steigenden Funktion die Ober-Summe für eine wachsende Zahl n von Intervallen gegen den selben Wert konvergiert wie die Unter-Summe. Daher definieren wir

$$\int_a^b f(x) dx := \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^n f\left(a + i \cdot \frac{b-a}{n}\right) \cdot \frac{b-a}{n} \quad (5.5)$$

Diesen Grenzwert nennen wir auch das *Integral* von f in dem Intervall $[a, b]$. Die so gegebene Definition ist zunächst nur für monoton wachsende Funktionen schlüssig, aber es ist offensichtlich, dass das Integral für monoton fallende Funktionen auf die selbe Weise berechnet werden kann. Ist nun eine Funktion f in dem Intervall f weder monoton fallend noch monoton steigend, so können wir versuchen, das Intervall so in Teilintervalle aufzuspalten, dass f in jedem Teilintervall monoton fallend oder monoton steigend ist. Da wir auf jedem dieser Teilintervalle das Integral nach der Formel (5.5) berechnen können, können wir dann auch insgesamt das Integral nach dieser Formel berechnen.

Aufgabe 34: Berechnen Sie das Integral

$$\int_0^b x^2 dx$$

nach der in (5.5) angegebenen Formel.

Definition 72 (Integral) Ist $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ eine Funktion, so dass der Grenzwert

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^n f\left(a + i \cdot \frac{b-a}{n}\right) \cdot \frac{b-a}{n}$$

existiert, so nennen wir f *integrierbar* und definieren das *Integral* von f in dem Intervall $[a, b]$ als

$$\int_a^b f(x) dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^n f\left(a + i \cdot \frac{b-a}{n}\right) \cdot \frac{b-a}{n}.$$

Der so eingeführte Integral-Begriff hat folgende Eigenschaften:

1. Linearität: Sind f und g zwei Funktionen, so dass das Integral über f bzw. g in dem Intervall $[a, b]$ definiert ist und sind $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$, so ist auch das Integral der Funktion

$$x \mapsto \alpha \cdot f(x) + \beta \cdot g(x)$$

definiert und es gilt

$$\int_a^b \alpha \cdot f(x) + \beta \cdot g(x) dx = \alpha \cdot \int_a^b f(x) dx + \beta \cdot \int_a^b g(x) dx.$$

2. Monotonie: Sind f und g zwei Funktionen, so dass das Integral über f und g in dem Intervall $[a, b]$ definiert ist, so gilt:

$$\left(\forall x \in [a, b] : f(x) \leq g(x) \right) \Rightarrow \int_a^b f(x) dx \leq \int_a^b g(x) dx.$$

Satz 73 (Mittelwert-Satz der Integral-Rechnung)

Es sei $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ eine stetige Funktion. Dann existiert ein $\xi \in [a, b]$, so dass gilt:

$$\int_a^b f(x) dx = f(\xi) \cdot (b - a).$$

Beweis: Da die Funktion f stetig ist, nimmt f auf dem Intervall $[a, b]$ ein Minimum und ein Maximum in den Punkten x_{min} und x_{max} an. Dann gilt

$$\forall x \in [a, b] : f(x_{min}) \leq f(x) \leq f(x_{max}).$$

Aufgrund der Monotonie des Integral-Operators folgt daraus sofort

$$\begin{aligned} \int_a^b f(x_{min}) dx &\leq \int_a^b f(x) dx \leq \int_a^b f(x_{max}) dx \\ \Leftrightarrow f(x_{min}) \cdot (b - a) &\leq \int_a^b f(x) dx \leq f(x_{max}) \cdot (b - a) \\ \Leftrightarrow f(x_{min}) &\leq \frac{\int_a^b f(x) dx}{b - a} \leq f(x_{max}) \end{aligned}$$

Die obige Ungleichungskette zeigt, dass

$$\frac{\int_a^b f(x) dx}{b - a} \in [f(x_{min}), f(x_{max})]$$

gilt. Aufgrund des Zwischenwert-Satzes nimmt die stetige Funktion f jeden Wert in dem Intervall $[f(x_{min}), f(x_{max})]$ an. Also gibt es ein $\xi \in [a, b]$, so dass

$$f(\xi) = \frac{\int_a^b f(x) dx}{b - a}$$

gilt und dass ist äquivalent zu

$$f(\xi) \cdot (b - a) = \int_a^b f(x) dx. \quad \square$$

Der Mittelwert-Satz versetzt uns in die Lage, einen Zusammenhang zwischen Differenzial-Rechnung und Integral-Rechnung herzustellen.

Satz 74 (Ableitung von Integralen)

Die Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ sei stetig. Definieren wir für $x \in [a, b]$ die Funktion $F : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ durch

$$F(x) := \int_a^x f(t) dt,$$

so ist die Funktion F im Intervall $[a, b]$ differenzierbar und es gilt

$$\frac{d}{dx} F(x) = f(x).$$

Beweis: Es gilt

$$\begin{aligned}
& \frac{d}{dx} F(x) \\
&= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{F(x+h) - F(x)}{h} \\
&= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{\int_a^{x+h} f(t) dt - \int_a^x f(t) dt}{h} \quad \text{nach Definition von } F \\
&= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{1}{h} \int_x^{x+h} f(t) dt \\
&= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{1}{h} \cdot (x+h-x) \cdot f(\xi_h) \quad \text{nach dem Mittelwertsatz für ein } \xi_h \in [x, x+h] \\
&= \lim_{h \rightarrow 0} f(\xi_h) \\
&= f(x) \quad \text{wegen } \xi_h \in [x, x+h].
\end{aligned}$$

Damit ist die Behauptung bewiesen. □

Definition 75 (Stamm-Funktion)

Ist $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ eine Funktion, so ist die Funktion $F : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ eine *Stamm-Funktion* von f , falls F differenzierbar ist und

$$\frac{d}{dx} F(x) = f(x)$$

gilt. In diesem Fall schreiben wir auch $F(x) = \int f(x) dx$. Der Ausdruck $\int f(x) dx$ wird auch als *unbestimmtes Integral* bezeichnet.

Die Schreibweise $F(x) = \int f(x) dx$ ist problematisch, denn die Stamm-Funktion einer gegebenen Funktion ist nicht eindeutig. Ist $F(x)$ eine Stamm-Funktion von $f(x)$ und definieren wir die Funktion G durch $G(x) := F(x) + c$ für eine beliebige Konstante c , so ist natürlich auch $G(x)$ eine Stamm-Funktion von f , denn es gilt

$$\frac{d}{dx} G(x) = \frac{d}{dx} F(x) + \frac{d}{dx} c = f(x) + 0 = f(x).$$

Umgekehrt gilt, dass zwei verschiedene Stamm-Funktionen zu einer Funktion f sich nur um eine Konstante unterscheiden. Dies sehen wir wie folgt: Angenommen, F_1 und F_2 seien zwei Stamm-Funktionen einer Funktion f , es gelte also

$$\frac{d}{dx} F_1(x) = f(x) \quad \text{und} \quad \frac{d}{dx} F_2(x) = f(x).$$

Dann definieren wir die Funktion H als $H(x) := F_1(x) - F_2(x)$. Damit gilt

$$\frac{d}{dx} H(x) = \frac{d}{dx} F_1(x) - \frac{d}{dx} F_2(x) = f(x) - f(x) = 0.$$

Nach Lemma 59 gibt es nun eine Konstante c , so dass $H(x) = c$ gilt. Dies zeigt, dass sich zwei verschiedene Stamm-Funktionen nur um eine Konstante unterscheiden. Wir kommen jetzt zu einem zentralen Ergebnis dieser Vorlesung.

Satz 76 (Hauptsatz der Differenzial- und Integral-Rechnung)

Die Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ sei stetig, $F : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ sei eine Stamm-Funktion von f und es gelte $u, v \in [a, b]$. Dann gilt

$$\int_u^v f(x) dx = F(v) - F(u).$$

Beweis: Definieren wir die Funktion $G(x)$ durch

$$G(x) := \int_a^x f(t) dt \quad \text{für alle } x \in [a, b],$$

so besagt Satz 74, dass die Funktion G eine Stamm-Funktion der Funktion f ist. Ist nun F eine beliebige weitere Stamm-Funktion von f , so haben wir gerade gesehen, dass die Stamm-Funktionen G und F sich nur um eine Konstante c unterscheiden können, es gilt also

$$F(x) = G(x) + c.$$

Damit haben wir

$$\begin{aligned} F(v) - F(u) &= G(v) + c - (G(u) + c) \\ &= G(v) - G(u) \\ &= \int_a^v f(t) dt - \int_a^u f(t) dt \\ &= \int_u^v f(t) dt. \end{aligned}$$

□

Der letzte Satz gibt Anlaß zu einer Schreibweise. Für eine Funktion F definieren wir

$$F(x) \Big|_u^v := F(v) - F(u).$$

Den letzten Satz können wir wie folgt umformulieren. Ist $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ eine differenzierbare Funktion, so ist f offenbar eine Stamm-Funktion der Funktion $f'(x)$. Also gilt dann

$$\int_u^v f'(x) dx = f(v) - f(u) = f(x) \Big|_u^v. \quad (5.6)$$

5.2 Regeln zur Berechnung von Integralen

Der Hauptsatz der Differenzial- und Integral-Rechnung ermöglicht es, Regeln zur Berechnung von Integralen aufzustellen. Tabelle 5.1 zeigt die Stamm-Funktionen der wichtigsten Funktionen. Um diese Tabelle zu verifizieren reicht es aus, die in der rechten Spalte der Tabelle angegebene Funktion nach x zu differenzieren. Wir führen dies exemplarisch für den Eintrag $\ln(x)$ vor. Es gilt

$$\begin{aligned} \frac{d}{dx}(x \cdot \ln(x) - x) &= \frac{d}{dx}(x \cdot \ln(x)) - \frac{d}{dx}x \\ &= 1 \cdot \ln(x) + x \cdot \frac{1}{x} - 1 \quad (\text{Produkt-Regel}) \\ &= \ln(x) + 1 - 1 \\ &= \ln(x) \end{aligned}$$

Damit ist gezeigt, dass $\int \ln(x) dx = x \cdot \ln(x) - x$ gilt. Die übrigen Einträge der Tabelle können auf ähnliche Weise verifiziert werden.

Bemerkenswert ist vielleicht noch die Stamm-Funktion von $\frac{1}{x}$. Für $x > 0$ gilt sicher

$$\frac{d}{dx} \ln(x) = \frac{1}{x}$$

Außerdem gilt nach der Ketten-Regel für $x < 0$

$$\frac{d}{dx} \ln(-x) = -1 \cdot \frac{1}{-x} = \frac{1}{x}.$$

Diese beiden Gleichungen können wir zu

$$\frac{d}{dx} \ln(|x|) = \frac{1}{x}$$

zusammen fassen und folglich haben wir

$$\int \frac{1}{x} dx = \ln(|x|).$$

Funktion $f(x)$	Stamm-Funktion $\int f(x) dx$
x^α mit $\alpha \neq -1$	$\frac{1}{\alpha + 1} \cdot x^{\alpha+1}$
$\frac{1}{x}$	$\ln(x)$
$\exp(x)$	$\exp(x)$
$\sin(x)$	$-\cos(x)$
$\cos(x)$	$\sin(x)$
$\tan(x)$	$-\ln(\cos(x))$
$\ln(x)$	$x \cdot \ln(x) - x$
$\frac{1}{1+x^2}$	$\arctan(x)$
$\frac{1}{\sqrt{1-x^2}}$	$\arcsin(x)$
$\frac{1}{\sqrt{1+x^2}}$	$\ln(x + \sqrt{1+x^2})$
$\arctan(x)$	$x \cdot \arctan(x) - \frac{1}{2} \cdot \ln(1+x^2)$

Tabelle 5.1: Tabelle einiger Integrale

Wir können die einzelnen Einträge der Tabelle zwar durch Differenzieren leicht verifizieren, aber dabei bleibt die Frage offen, wie die Einträge dieser Tabelle gefunden wurden. Wir stellen jetzt einige Sätze auf, mit deren Hilfe wir Stamm-Funktionen gegebener Funktionen berechnen können. Wir erhalten diese Sätze indem wir die Regeln, die wir zur Differenzierung aufgestellt haben, umdrehen.

5.2.1 Die Substitutions-Regel

Wir beginnen damit, dass wir die Ketten-Regel umstellen.

$$\begin{aligned}
\frac{d}{dx}h(f(x)) &= f'(x) \cdot h'(f(x)) && \text{Ketten-Regel} \\
\Rightarrow \int \frac{d}{dx}h(f(x)) dx &= \int f'(x) \cdot h'(f(x)) dx + c && \text{Stamm-Funktion bilden} \\
\Rightarrow h(f(x)) &= \int f'(x) \cdot h'(f(x)) dx + c && \text{Definition der Stamm-Funktion.}
\end{aligned}$$

Nach dem Hauptsatz können wir hier bei den Integralen Grenzen einsetzen. Dann erhalten wir

$$\int_a^b f'(x) \cdot h'(f(x)) dx = h(f(b)) - h(f(a)) \quad (5.7)$$

Wir definieren nun $g(x) := h'(x)$. Dann ist h eine Stamm-Funktion der Funktion g , es gilt also $h(x) = \int g(x) dx + d$, was wir nach dem Hauptsatz auch als

$$h(f(b)) - h(f(a)) = \int_{f(a)}^{f(b)} g(x) dx \quad (5.8)$$

schreiben können. Ersetzen wir in Gleichung (5.7) h' durch g so erhalten wir zusammen mit Gleichung (5.8) die *Substitutions-Regel*:

$$\int_a^b f'(x) \cdot g(f(x)) dx = \int_{f(a)}^{f(b)} g(x) dx \quad (5.9)$$

Sie können sich die Substitutions-Regel mit Hilfe der folgenden suggestiven Pseudo-Ableitung leicht merken. Wir gehen aus von dem unbestimmten Integral

$$\int g(y) dy.$$

Hier führen wir die Variablen-Transformation $y = f(x)$ durch. Dann gilt

$$\frac{dy}{dx} = f'(x)$$

Wir rechnen nun mit dem Ausdruck $\frac{dy}{dx}$ so, als ob es ein gewöhnlicher Bruch wäre und stellen die letzte Gleichung nach dy um. Dann haben wir

$$dy = f'(x) \cdot dx$$

Ersetzen wir in dem ursprünglichen Integral dy durch diesen Ausdruck, so haben wir

$$\int g(y) dy = \int g(f(x)) \cdot f'(x) dx$$

Das ist aber genau die Substitutions-Regel.

Aufgabe 35: Als Anwendung der Substitutions-Regel zeigen wir die Berechnung von $\int \tan(t) dt$:

$$\begin{aligned} \int_0^x \tan(t) dt &= \int_0^x \frac{\sin(t)}{\cos(t)} dt \\ &= - \int_0^x (-\sin(t)) \cdot \frac{1}{\cos(t)} dt \\ &= - \int_{\cos(0)}^{\cos(x)} \frac{1}{t} dt \\ &= - \left(\ln(|\cos(x)|) - \ln(|\cos(0)|) \right) \\ &= \ln(|\cos(0)|) - \ln(|\cos(x)|) \\ &= \ln(1) - \ln(|\cos(x)|) \\ &= -\ln(|\cos(x)|) \end{aligned}$$

Damit ist gezeigt, dass $x \mapsto -\ln(|\cos(x)|)$ eine Stamm-Funktion von $x \mapsto \tan(x)$ ist:

$$\int \tan(x) dx = -\ln(|\cos(x)|) + c.$$

Wir zeigen, wie sich die Stamm-Funktion von $\tan(x)$ suggestiver berechnen läßt. Bei dem Integral $\int \frac{\sin(t)}{\cos(t)} dt$ führen wir die Variablen-Transformation $x = \cos(t)$ durch. Dann gilt

$$\frac{dx}{dt} = -\sin(t) \Leftrightarrow dt = \frac{dx}{-\sin(t)}.$$

Ersetzen wir in dem Integral $\int \frac{\sin(t)}{\cos(t)} dt$ den Ausdruck dt durch $\frac{dx}{-\sin(t)}$ und $\cos(t)$ durch x , so erhalten wir

$$\int \frac{\sin(t)}{\cos(t)} dt = \int \frac{\sin(t)}{x} \cdot \frac{dx}{-\sin(t)} = - \int \frac{1}{x} dx = -\ln(|x|) = -\ln(|\cos(t)|).$$

Das Rechnen mit den *infinitesimalen* Größen dx und dt ist offensichtlich intuitiver als die formale Anwendung der Substitutions-Regel.

Aufgabe 36: Berechnen Sie das Integral

$$\int \frac{x}{1+x^2} dx$$

mit Hilfe der Substitutions-Regel.

5.2.2 Partielle Integration

Als nächstes überlegen wir, wie wir aus der Produkt-Regel der Differenzial-Rechnung eine Regel zur Berechnung von Integralen gewinnen können. Es gilt

$$\frac{d}{dx}(f(x) \cdot g(x)) = f'(x) \cdot g(x) + f(x) \cdot g'(x) \quad (\text{Umstellen})$$

$$\Leftrightarrow f'(x) \cdot g(x) = \frac{d}{dx}(f(x) \cdot g(x)) - f(x) \cdot g'(x) \quad (\text{Stamm-Funktion})$$

$$\Leftrightarrow \int f'(x) \cdot g(x) dx = \int \frac{d}{dx}(f(x) \cdot g(x)) dx - \int f(x) \cdot g'(x) dx$$

Die Stamm-Funktion von $\frac{d}{dx}(f(x) \cdot g(x))$ ist natürlich $f(x) \cdot g(x)$, also haben wir

$$\int f'(x) \cdot g(x) dx = f(x) \cdot g(x) - \int f(x) \cdot g'(x) dx \quad (5.10)$$

gefunden. Diese Gleichung setzt die Stamm-Funktionen von $f'(x) \cdot g(x)$ und $f(x) \cdot g'(x)$ in Beziehung: Die Stamm-Funktion der ersten Funktion kann auf die Stamm-Funktion der zweiten Funktion zurück geführt werden. Die Regel zur partiellen Integration läßt sich nicht nur für die Berechnung der Stamm-Funktion eines Produkts einsetzen, sondern sie wird auch benutzt um die Integrale von Umkehr-Funktionen zu bestimmen. Als Beispiel zeigen wir, wie sich das Integral der Funktion $\ln(x)$ mittels partieller Integration bestimmen läßt.

$$\begin{aligned} \int \ln(x) dx &= \int 1 \cdot \ln(x) dx \\ &= x \cdot \ln(x) - \int x \cdot \frac{d}{dx} \ln(x) dx \\ &= x \cdot \ln(x) - \int x \cdot \frac{1}{x} dx \\ &= x \cdot \ln(x) - \int 1 dx \\ &= x \cdot \ln(x) - x \end{aligned}$$

Aufgabe 37: Berechnen Sie die Stamm-Funktion $\int \arctan(x) dx$.

5.2.3 Das Integral von Umkehr-Funktionen

Wir zeigen noch einen anderen Weg, mit dem das Integral der Umkehr-Funktion einer Funktion berechnet werden kann. Es sei also eine Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ geben, die eine Umkehr-Funktion hat. Wir setzen zur Vereinfachung jetzt voraus, dass die Funktion f monoton steigend ist, wenn f monoton fallend ist, liegen die Dinge analog. Die Umkehr-Funktion von f sei die Funktion $g : [f(a), f(b)] \rightarrow \mathbb{R}$, für alle $x \in [a, b]$ gilt also $g(f(x)) = x$. Analog gilt dann für alle $y \in [f(a), f(b)]$ $f(g(y)) = y$. Abbildung 5.3 zeigt die Funktion. Durch Spiegelung an der Winkelhalbierung geht die Funktion f in die Umkehr-Funktion über, wenn wir also die y -Achse als x -Achse ansehen, zeigt die Abbildung die Umkehr-Funktion. Wir betrachten jetzt die Fläche des Rechtecks, dessen linke untere Ecke im Ursprung des Koordinaten-Systems liegt und dessen rechte obere Ecke die

Koordinaten $\langle b, f(b) \rangle$ hat. Dieses Rechtecks hat den Flächeninhalt $b \cdot f(b)$. Diese Fläche setzt sich aus drei Teilen zusammen, die in der Figur unterschiedlich markiert sind.

1. Links unten findet sich ein kleines Rechteck, das mit diagonalen Streifen markiert ist. Die linke untere Ecke dieses Rechtecks liegt ebenfalls im Ursprung des Koordinaten-Systems, die rechte obere Ecke hat die Koordinaten $\langle a, f(a) \rangle$. Damit hat dieses Rechteck die Fläche $a \cdot f(a)$.
2. Die vertikal schraffierte Fläche ist die Fläche unter der Kurve $f(x)$ und ist folglich gegeben durch das Integral

$$\int_a^b f(x) dx.$$

3. Die horizontal schraffierte Fläche ist die Fläche unter der Kurve $g(y)$ der Umkehr-Funktion und ist daher gegeben durch

$$\int_{f(a)}^{f(b)} g(y) dy.$$

Natürlich ist die gesamte Fläche des Rechtecks die Summe aller drei Teile, es gilt also

$$b \cdot f(b) = a \cdot f(a) + \int_a^b f(t) dt + \int_{f(a)}^{f(b)} g(t) dt \quad (5.11)$$

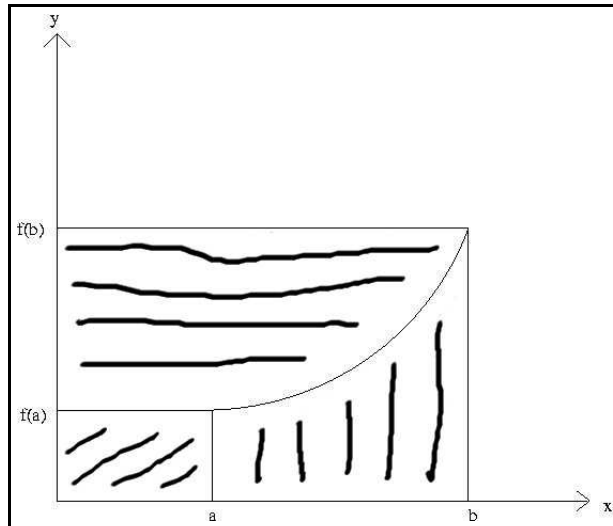


Abbildung 5.3: Die Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$

Ersetzen wir in dieser Gleichung b durch x und stellen die Gleichung nach dem ersten Integral um, so erhalten wir

$$\int_a^x f(t) dt = x \cdot f(x) - a \cdot f(a) - \int_{f(a)}^{f(x)} g(t) dt \quad (5.12)$$

Sind wir nur an Stamm-Funktionen interessiert, so können wir den konstanten Term $a \cdot f(a)$ weglassen. Dann schreibt sich die letzte Gleichung als

$$\int f(x) dx = x \cdot f(x) - G(f(x)) \quad \text{mit} \quad G(x) := \int g(x) dx. \quad (5.13)$$

Als Beispiel betrachten wir die Funktion $f(x) = \ln(x)$ mit der Umkehr-Funktion $g(x) = \exp(x)$. Wegen $\int \exp(x) dx = \exp(x)$ gilt

$$\int \ln(x) = x \cdot \ln(x) - \exp(\ln(x)) = x \cdot \ln(x) - x.$$

5.2.4 Beispiele

Wir geben ein Paar Beispiele die zeigen, wie Integrale berechnet werden. Als erstes berechnen wir den Flächen-Inhalt eines Kreises. Ein Kreis vom Radius 1 kann nach dem Satz des Pythagoras in der Koordinaten-Ebene durch die Relation $x^2 + y^2 = 1$ dargestellt werden. Lösen wir diese Gleichung nach x auf, so wird der Kreis durch die beiden Funktion $x \mapsto \sqrt{1-x^2}$ und Funktion $x \mapsto -\sqrt{1-x^2}$ für $x \in [-1, 1]$ beschrieben. Wir beschränken uns nun auf den Viertelkreis im ersten Quadranten der Koordinaten-Ebene. Die Fläche dieses Viertelkreises ist durch das Integral

$$I := \int_0^1 \sqrt{1-x^2} \, dx$$

gegeben, dass wir nun berechnen. Zunächst führen wir die Koordinaten-Transformation $x = \sin(t)$ durch. Dann erhalten wir

$$\frac{dx}{dt} = \cos(t), \text{ also } dx = \cos(t) \cdot dt.$$

Wegen $0 = \sin(0)$ und $1 = \sin(\pi/2)$ haben wir

$$I = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sqrt{1-\sin^2(t)} \cdot \cos(t) \, dt = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \cos(t) \cdot \cos(t) \, dt.$$

Dieses Integral versuchen wir nun mit partieller Integration zu vereinfachen. Wir setzen in Gleichung 5.10 $f'(t) := \cos(t)$ und $g(t) = \cos(t)$. Wegen $f(t) = \sin(t)$ und $g'(t) = -\sin(t)$ erhalten wir dann

$$I = \sin(t) \cdot \cos(t) \Big|_0^{\frac{\pi}{2}} + \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin(t) \cdot \sin(t) \, dt = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^2(t) \, dt$$

Damit haben wir jetzt

$$I = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \cos^2(t) \, dt = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^2(t) \, dt$$

Daraus folgt

$$\Leftrightarrow 2 \cdot I = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \cos^2(t) \, dt + \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^2(t) \, dt$$

$$\Leftrightarrow 2 \cdot I = \int_0^{\frac{\pi}{2}} (\cos^2(t) + \sin^2(t)) \, dt$$

$$\Leftrightarrow 2 \cdot I = \int_0^{\frac{\pi}{2}} 1 \, dt$$

$$\Leftrightarrow 2 \cdot I = t \Big|_0^{\frac{\pi}{2}}$$

$$\Leftrightarrow 2 \cdot I = \frac{\pi}{2}$$

$$\Leftrightarrow I = \frac{\pi}{4}$$

Damit haben wir für die Fläche eines Viertelkreises den Wert $\frac{\pi}{4}$ gefunden, der ganze Kreis hat also die Fläche π .

5.3 Berechnung der Bogenlänge

Gelegentlich tritt das Problem auf, die Länge der Strecke zu berechnen, die durch einen Funktions-Graphen beschrieben wird. Geht es darum, die Bogenlänge des Graphen der Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ in dem Intervall $[a, b]$ zu berechnen, so zerlegen wir das Intervall in $[a, b]$ in n Teilintervalle der Länge

$$h = \frac{b - a}{n}.$$

Das Teilstück des Graphen, das von dem Punkt $\langle x, f(x) \rangle$ zu dem Punkt $\langle x + dx, f(x + dx) \rangle$ kann für kleine Werte von h näherungsweise durch die Sekante von dem Punkt $\langle x, f(x) \rangle$ zu dem Punkt $\langle x + dx, f(x + dx) \rangle$ approximiert werden. Nach dem Satz des Pythagoras hat diese Sekante die Länge

$$ds = \sqrt{dx^2 + (f(x + dx) - f(x))^2}.$$

Nach Definition der Ableitung von f gilt für kleine Werte von dx

$$\frac{f(x + dx) - f(x)}{x + dx - x} \approx f'(x).$$

Also haben wir

$$f(x + dx) - f(x) \approx f'(x)dx.$$

Setzen wir diesen Wert in der obigen Formel für ein, so erhalten wir

$$ds \approx \sqrt{dx^2 + (f'(x) \cdot dx)^2} = \sqrt{1 + \left(\frac{df}{dx}\right)^2} \cdot dx.$$

Die Länge l des gesamten Funktions-Graphen erhalten wir, wenn wir diesen Ausdruck von a bis b aufintegrieren:

$$l = \int_a^b \sqrt{1 + \left(\frac{df}{dx}\right)^2} dx.$$

Beispiel: Wir berechnen die Länge l des Kreisbogens, der durch die Funktion $f : [0, 1] \rightarrow \mathbb{R}$ mit

$$f(x) = \sqrt{1 - x^2}$$

definiert ist. Anschaulich sollte diese Länge ein Viertel des Umfangs eines Kreises mit Radius 1 betragen. Es gilt

$$\frac{df}{dx} = \frac{1}{2} \cdot \frac{-2 \cdot x}{\sqrt{1 - x^2}} = \frac{-x}{\sqrt{1 - x^2}}.$$

Also haben wir für die Länge

$$\begin{aligned} l &= \int_0^1 \sqrt{1 + \frac{x^2}{1 - x^2}} dx \\ &= \int_0^1 \frac{1}{\sqrt{1 - x^2}} dx \end{aligned}$$

An dieser Stelle wenden wir die Substitutions-Regel

$$\int_a^b f'(x) \cdot g(f(x)) dx = \int_{f(a)}^{f(b)} g(x) dx$$

an, wobei wir

$$f(x) := \sin(x), \quad g(x) := \frac{1}{\sqrt{1 - x^2}}, \quad a := 0 \quad \text{und} \quad b := \frac{\pi}{2}$$

setzen. Wegen

$$f'(x) = \cos(x), \quad \sin(0) = 0 \quad \text{und} \quad \sin(\pi/2) = 1$$

folgt dann

$$\begin{aligned} l &= \int_0^{\pi/2} \cos(x) \cdot \frac{1}{\sqrt{1 - \sin^2(x)}} dx \\ &= \int_0^{\pi/2} \cos(x) \cdot \frac{1}{\cos(x)} dx \\ &= \int_0^{\pi/2} 1 dx \\ &= x \Big|_0^{\pi/2} \\ &= \frac{\pi}{2} \end{aligned}$$

und das ist genau der Umfang eines Viertel-Kreises. \diamond

Aufgabe 38: Berechnen Sie die Bogenlänge der Parabel $x \mapsto x^2$ im Intervall $[0, 1]$. \diamond

5.4 Uneigentliche Integrale

Ist bei dem Ausdruck $\int_a^b f(x) dx$ die Funktion f an einer der Intervall-Grenzen nicht definiert, so bezeichnen wir den Ausdruck als uneigentliches Integral. Wir betrachten nur den Fall, dass die Funktion f nur in dem halboffenen Intervall $(a, b]$ definiert ist, während f in dem Punkt a nicht definiert sein soll. Beispielsweise ist die Funktion $x \mapsto \frac{1}{\sqrt{x}}$ im Punkt $x = 0$ nicht definiert. In diesem Fall definieren wir

$$\int_a^b f(x) dx := \lim_{\substack{h \rightarrow 0 \\ h > 0}} \int_{a+h}^b f(x) dx.$$

Wir betrachten als Beispiel das Integral der Funktion $x \mapsto \frac{1}{\sqrt{x}}$ in dem Intervall $[0, 1]$. Es gilt

$$\int_0^1 \frac{1}{\sqrt{x}} dx = \lim_{\substack{h \rightarrow 0 \\ h > 0}} \int_h^1 \frac{1}{\sqrt{x}} dx = \lim_{\substack{h \rightarrow 0 \\ h > 0}} 2 \cdot \sqrt{x} \Big|_h^1 = \lim_{\substack{h \rightarrow 0 \\ h > 0}} 2 \cdot \sqrt{1} - 2 \cdot \sqrt{h} = 2.$$

Ein anderer Fall liegt vor, wenn eine der Integrations-Grenzen den Wert Unendlich hat. Wir betrachten nur den Fall $b = \infty$. In diesem Fall definieren wir

$$\int_a^\infty f(t) dt := \lim_{x \rightarrow \infty} \int_a^x f(t) dt.$$

Wir betrachten als Beispiel die Funktion $x \mapsto \frac{1}{x^2}$ in dem Intervall $[1, \infty)$. Es gilt

$$\int_1^\infty \frac{1}{t^2} dt = \lim_{x \rightarrow \infty} \int_1^x \frac{1}{t^2} dt = \lim_{x \rightarrow \infty} -\frac{1}{t} \Big|_1^x = \lim_{x \rightarrow \infty} -\frac{1}{x} + \frac{1}{1} = 1.$$

Indem wir Reihen und uneigentliche Integrale in Beziehung setzen, können wir unter Umständen leicht sehen, dass eine Reihe konvergiert, denn es gilt der folgende Satz.

Satz 77 (Integral-Vergleichskriterium) Es sei $f : [1, \infty) \rightarrow \mathbb{R}_+$ eine monoton fallende Funktion. Dann gilt

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^n f(i) \text{ existiert} \quad \text{g.d.w.} \quad \lim_{x \rightarrow \infty} \int_1^x f(t) dt \text{ existiert.}$$

Beweis: Da die Funktion f monoton ist, gelten für alle $i \in \mathbb{N}$ mit $i > 1$ und alle $x \in [i-1, i]$ die Ungleichungen

$$i-1 \leq x \quad \text{und} \quad x \leq i.$$

Da die Funktion f monoton fallend ist, folgt daraus

$$f(i) \leq f(x) \quad \text{und} \quad f(x) \leq f(i-1).$$

Aus der Monotonie des Integral-Operators folgt nun

$$\int_{i-1}^i f(i) dx \leq \int_{i-1}^i f(x) dx \quad \text{und} \quad \int_{i-1}^i f(x) dx \leq \int_{i-1}^i f(i-1) dx$$

Das Integral über die konstanten Funktionen $x \mapsto f(i)$ bzw. $x \mapsto f(i-1)$ liefert nur den konstanten Funktions-Wert multipliziert mit der Länge des Intervalls, die natürlich 1 ist. Also haben wir die Ungleichungen

$$f(i) \leq \int_{i-1}^i f(x) dx \quad \text{und} \quad \int_{i-1}^i f(x) dx \leq f(i-1)$$

gezeigt. Summieren wir diese Ungleichungen für alle i aus der Menge $\{2, \dots, n\}$, so erhalten wir

$$\sum_{i=2}^n f(i) \leq \int_1^n f(x) dx \quad \text{und} \quad \int_1^n f(x) dx \leq \sum_{i=2}^n f(i-1)$$

Bei der ersten Ungleichung addieren wir noch $f(1)$, bei der zweiten Ungleichung ersetzen wir die Summations-Variable i durch $i+1$ und erhalten:

$$\sum_{i=1}^n f(i) \leq f(1) + \int_1^n f(x) dx \quad \text{und} \quad \int_1^n f(x) dx \leq \sum_{i=1}^{n-1} f(i)$$

Falls nun das Integral $\int_1^\infty f(x) dx$ existiert, so gilt

$$\sum_{i=1}^n f(i) \leq f(1) + \int_1^n f(x) dx \leq f(1) + \int_1^\infty f(x) dx$$

Damit ist dann die Folge

$$\left(\sum_{i=1}^n f(i) \right)_{n \in \mathbb{N}}$$

monoton und beschränkt, folglich konvergent. Existiert umgekehrt der Grenzwert $\sum_{i=1}^\infty f(i)$, so ist aufgrund der zweiten Ungleichung auch die Folge

$$\left(\int_1^n f(x) dx \right)_{n \in \mathbb{N}}$$

beschränkt. Da diese Folge außerdem monoton ist, folgt die Konvergenz. □

Beispiel: Wir betrachten das Integral

$$\int_1^\infty \frac{1}{x^\alpha} dx \quad \text{für } \alpha > 0..$$

Falls $\alpha \neq 1$ ist, gilt

$$\begin{aligned}
I(\alpha) &:= \int_1^\infty \frac{1}{t^\alpha} dt \\
&= \lim_{x \rightarrow \infty} \int_1^x \frac{1}{t^\alpha} dt = \lim_{x \rightarrow \infty} \left. \frac{t^{1-\alpha}}{1-\alpha} \right|_1^x \\
&= \lim_{x \rightarrow \infty} \frac{x^{1-\alpha} - 1}{1-\alpha}
\end{aligned}$$

Im Falle $\alpha = 1$ haben wir

$$I(\alpha) = \ln(x).$$

Nun hängt alles davon ab, ob $\alpha < 1$, $\alpha = 1$ oder $\alpha > 1$ ist.

1. Falls $\alpha < 1$ ist, haben wir $1 - \alpha > 0$ und damit gilt

$$I(\alpha) = \lim_{x \rightarrow \infty} \frac{x^{1-\alpha} - 1}{1-\alpha} = \infty$$

Also konvergiert die Summe

$$\sum_{i=1}^{\infty} \frac{1}{i^\alpha}$$

in diesem Fall nicht.

2. Falls $\alpha = 1$ ist, gilt

$$I(1) = \lim_{x \rightarrow \infty} \int_1^x \frac{1}{t} dt = \lim_{x \rightarrow \infty} \ln(x) = \infty$$

Im letzten Schritt haben wir hier ausgenutzt, dass

$$\lim_{x \rightarrow \infty} \ln(x) = \infty$$

gilt. Das folgt daraus, dass die Funktion $x \mapsto \ln(x)$ einerseits monoton steigend ist und dass andererseits

$$\ln(\exp(n)) = n \quad \text{für alle } n \in \mathbb{N}$$

gilt, denn die letzte Gleichung zeigt, dass die Funktion $x \mapsto \ln(x)$ beliebig groß wird.

Insgesamt können wir nun aus dem Integral-Vergleichskriterium folgern, dass die harmonische Reihe divergiert:

$$\sum_{i=1}^{\infty} \frac{1}{i} = \infty.$$

3. Falls $\alpha > 1$ ist, haben wir $1 - \alpha < 0$ und damit gilt

$$I(\alpha) = \lim_{x \rightarrow \infty} \frac{x^{1-\alpha} - 1}{1-\alpha} = \frac{1}{\alpha - 1}$$

In diesem Fall konvergiert also die Summe

$$\sum_{i=1}^{\infty} \frac{1}{i^\alpha}.$$

Aufgabe 39: Untersuchen Sie mit Hilfe des Integral-Vergleichskriteriums, ob die Reihe

$$\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n \cdot (n+1)}$$

konvergiert.

5.5 Numerische Integration

Die Gleichung $x = \cos(x)$ haben wir zwar numerisch lösen können, aber wir waren nicht in der Lage, einen algebraischen Ausdruck für die Lösung anzugeben. Auch bei der Integration von Funktionen ist es nicht immer möglich, einen algebraischen Ausdruck für die Stamm-Funktion einer Funktion anzugeben. Beispielsweise konnte Liouville (Joseph Liouville, 1809 – 1882) beweisen, dass das unbestimmte Integral

$$\int \exp(-x^2) dx$$

nicht auf die uns bisher bekannten Funktionen zurück geführt werden kann [7]. Für die praktische Berechnung von Integralen benötigen wir daher numerische Methoden.

5.5.1 Die Trapez-Regel

Die wohl naheliegendste Methode besteht darin, die zu integrierende Funktion stückweise linear zu interpolieren und dann das zur berechnende Integral durch das Integral der stückweise linearen Funktion zu approximieren. Ist das Integral $\int_a^b f(t) dt$ zu berechnen, so wird zunächst das Intervall $[a, b]$ in n gleich große Teilintervalle zerlegt. Das i -te Teilintervall ist $[a + (i - 1) \cdot h, a + i \cdot h]$ mit $h := \frac{b-a}{n}$ und $i = 1, \dots, n$. Wir setzen $x_i := a + i \cdot h$. Innerhalb des i -ten Teilintervalls wird die Funktion $f(x)$ dann durch die Gerade

$$g(x) = f(x_{i-1}) \cdot \frac{x - x_i}{x_{i-1} - x_i} + f(x_i) \cdot \frac{x - x_{i-1}}{x_i - x_{i-1}}$$

approximiert. Das Integral über $g(x)$ im Intervall $[x_{i-1}, x_i]$ ist dann

$$\begin{aligned} & \int_{x_{i-1}}^{x_i} g(x) dx \\ &= \int_{x_{i-1}}^{x_i} f(x_{i-1}) \cdot \frac{x - x_i}{x_{i-1} - x_i} + f(x_i) \cdot \frac{x - x_{i-1}}{x_i - x_{i-1}} dx \\ &= \frac{f(x_{i-1})}{x_{i-1} - x_i} \cdot \int_{x_{i-1}}^{x_i} (x - x_i) dx + \frac{f(x_i)}{x_i - x_{i-1}} \cdot \int_{x_{i-1}}^{x_i} (x - x_{i-1}) dx \\ &= \frac{f(x_{i-1})}{x_{i-1} - x_i} \cdot \frac{1}{2} \cdot (x - x_i)^2 \Big|_{x_{i-1}}^{x_i} + \frac{f(x_i)}{x_i - x_{i-1}} \cdot \frac{1}{2} \cdot (x - x_{i-1})^2 \Big|_{x_{i-1}}^{x_i} \\ &= -\frac{f(x_{i-1})}{x_{i-1} - x_i} \cdot \frac{1}{2} \cdot (x_{i-1} - x_i)^2 + \frac{f(x_i)}{x_i - x_{i-1}} \cdot \frac{1}{2} \cdot (x_i - x_{i-1})^2 \\ &= \frac{1}{2} \cdot f(x_{i-1}) \cdot (x_i - x_{i-1}) + \frac{1}{2} \cdot f(x_i) \cdot (x_i - x_{i-1}) \\ &= \frac{1}{2} \cdot (f(x_i) + f(x_{i-1})) \cdot (x_i - x_{i-1}) \end{aligned}$$

Die letzte Formel lässt sich geometrisch deuten, denn der Ausdruck

$$\frac{1}{2} \cdot (f(x_i) + f(x_{i-1})) \cdot (x_i - x_{i-1})$$

beschreibt gerade die Fläche eines Trapezes mit der Breite $h = x_i - x_{i-1}$ und Seiten der Länge $f(x_i)$ und $f(x_{i-1})$. Daher wird dieses Verfahren zur Berechnung eines Integrals auch als *Trapez-Regel* bezeichnet. Um das Integral über das gesamte Intervall $[a, b]$ zu berechnen, müssen wir die

Integrale über die einzelnen Intervalle lediglich aufsummieren. Wir erhalten dann

$$\begin{aligned}\int_a^b f(x) dx &\approx \sum_{i=1}^n \frac{1}{2} \cdot (f(x_i) + f(x_{i-1})) \cdot (x_i - x_{i-1}) \\ &= \sum_{i=1}^n \frac{1}{2} \cdot (f(a + i \cdot h) + f(a + (i-1) \cdot h)) \cdot h \\ &= \left(\frac{1}{2} \cdot f(a) + \sum_{i=1}^{n-1} f\left(a + i \cdot \frac{b-a}{n}\right) + \frac{1}{2} \cdot f(b) \right) \cdot \frac{b-a}{n}\end{aligned}$$

Abbildung 5.4 auf Seite 119 zeigt die numerische Berechnung des Integrals $\int_0^1 \exp(-x^2) dx$ mit Hilfe der Trapez-Regel. In diesem Fall ist $n = 3$. Führen wir die Berechnung tatsächlich aus, so erhalten wir die Näherung

$$\int_0^1 \exp(-x^2) dx \approx 0.7399864752 \dots$$

Der exakte Wert ist 0.7468241328, unter Berücksichtigung der Tatsache, dass wir $n = 3$ gewählt haben ist die Näherung also gar nicht so schlecht. Erhöhen wir n auf den Wert 300, so erhalten wir mit der Trapez-Regel die Näherung 0.7468234519, der Fehler ist dann also kleiner als 10^{-6} . Im nächsten Satz geben wir eine theoretische Analyse des Fehlers.

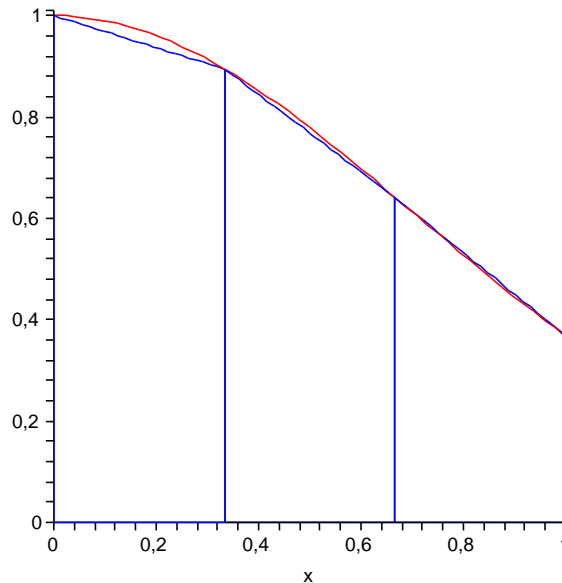


Abbildung 5.4: Berechnung des Integrals $\int_0^1 \exp(-x^2) dx$ mit Hilfe der Trapez-Regel.

Satz 78 Ist die Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ zweimal differenzierbar, gilt

$$|f^{(2)}(x)| \leq K \quad \text{für alle } x \in [a, b]$$

und definieren wir gemäß der Trapez-Regel

$$I_{\text{Trapez}} := \left(\frac{1}{2} \cdot f(a) + \sum_{i=1}^{n-1} f\left(a + i \cdot \frac{b-a}{n}\right) + \frac{1}{2} \cdot f(b) \right) \cdot \frac{b-a}{n}$$

so kann der Unterschied zwischen dem exakten Integral und der Näherung I_{Trapez} wie folgt abgeschätzt werden:

$$\left| \int_a^b f(x) dx - I_{\text{Trapez}} \right| \leq \frac{K}{12} \cdot \frac{(b-a)^3}{n^2}$$

Beweis: Bei der Ableitung der Trapez-Regel haben wir $f(x)$ durch ein lineares Polynom interpoliert. Nach Satz 63 gilt für den Unterschied zwischen $f(x)$ und dem interpolierenden Polynom $p(x)$ vom Grad n

$$f(x) - p(x) = \frac{f^{(n+1)}(\xi)}{(n+1)!} \cdot \prod_{i=0}^n (x - x_i).$$

Dabei ist ξ ein nicht näher bekannter Wert aus dem Intervall $[a, b]$. Bei linearer Interpolation ist $n = 1$ und also haben wir

$$f(x) - p(x) = \frac{f^{(2)}(\xi)}{2} \cdot (x - x_{i-1}) \cdot (x - x_i).$$

Aufgrund der Voraussetzung über die zweite Ableitung von $f(x)$ haben wir also

$$|f(x) - p(x)| \leq \frac{K}{2} \cdot |(x - x_{i-1}) \cdot (x - x_i)| \quad (5.14)$$

In dem Intervall $[x_{i-1}, x_i]$ gilt $x - x_{i-1} \geq 0$ und $x - x_i \leq 0$, also haben wir

$$|(x - x_{i-1}) \cdot (x - x_i)| = -(x - x_{i-1}) \cdot (x - x_i).$$

Integrieren wir die Ungleichung 5.14 in dem Intervall $[x_{i-1}, x_i]$, so erhalten wir

$$\begin{aligned} & \left| \int_{x_{i-1}}^{x_i} f(x) dx - \int_{x_{i-1}}^{x_i} p(x) dx \right| \\ & \leq \int_{x_{i-1}}^{x_i} |f(x) - p(x)| dx \\ & \leq \frac{K}{2} \cdot \int_{x_{i-1}}^{x_i} |(x - x_{i-1}) \cdot (x - x_i)| dx \\ & \leq -\frac{K}{2} \cdot \int_{x_{i-1}}^{x_i} (x - x_{i-1}) \cdot (x - x_i) dx \\ & = -\frac{K}{2} \cdot \frac{-1}{6} \cdot (x_i - x_{i-1})^3 \\ & = \frac{K}{12} \cdot (x_i - x_{i-1})^3 \end{aligned}$$

Diese Ungleichung gilt nun für jedes $i = 1, \dots, n$. Summieren wir diese Ungleichungen für alle Intervalle auf, so erhalten wir

$$\begin{aligned} \left| \int_a^b f(x) dx - I_{\text{Trapez}} \right| & \leq \sum_{i=1}^n \frac{K}{12} \cdot (x_i - x_{i-1})^3 \\ & \leq \sum_{i=1}^n \frac{K}{12} \cdot \left(\frac{b-a}{n} \right)^3 \\ & \leq n \cdot \frac{K}{12} \cdot \left(\frac{b-a}{n} \right)^3 \\ & \leq \frac{K}{12} \cdot \frac{(b-a)^3}{n^2} \end{aligned}$$

Falls wir also die Zahl der Intervalle verzehnfachen, sinkt der Fehler auf ein Hundertstel. \square

Aufgabe 40: Berechnen Sie, in wieviele Teilintervalle das Intervall $[0, 1]$ aufgeteilt werden muss, wenn das Integral

$$\int_0^1 e^{-x^2} dx$$

mit Hilfe der Trapez-Regel mit einer Genauigkeit von 10^{-6} berechnet werden soll. \diamond

5.5.2 Die Simpson'sche Regel

Anstatt die zu integrierende Funktion f durch ein lineares Polynom zu interpolieren, können wir f auch durch ein Polynom zweiten Grades interpolieren. Wir brauchen dann natürlich drei Stützstellen. Daher integrieren wir jetzt nicht mehr über ein Intervall $[x_{i-1}, x_i]$, sondern nehmen statt dessen das Intervall $[x_{i-1}, x_{i+1}]$ und benutzen x_{i-1} , x_i und x_{i+1} als Stützstellen. Die Funktion $f(x)$ approximieren wir in dem Intervall mit der Methode von Lagrange nach der Formel

$$\begin{aligned} p(x) &= f(x_{i-1}) \cdot \frac{(x - x_i) \cdot (x - x_{i+1})}{(x_{i-1} - x_i) \cdot (x_{i-1} - x_{i+1})} \\ &+ f(x_i) \cdot \frac{(x - x_{i-1}) \cdot (x - x_{i+1})}{(x_i - x_{i-1}) \cdot (x_i - x_{i+1})} \\ &+ f(x_{i+1}) \cdot \frac{(x - x_{i-1}) \cdot (x - x_i)}{(x_{i+1} - x_{i-1}) \cdot (x_{i+1} - x_i)} \end{aligned}$$

Setzen wir hier $x_{i-1} = x_i - h$ und $x_{i+1} = x_i + h$ und integrieren dann $p(x)$ in dem Intervall $[x_i - h, x_i + h]$, so erhalten wir mit Hilfe von Maple das Ergebnis

$$\int_{x_{i-1}}^{x_{i+1}} p(x) dx = \frac{1}{6} \cdot (f(x_{i-1}) + 4 \cdot f(x_i) + f(x_{i+1})) \cdot (x_{i+1} - x_{i-1})$$

Unterteilen wir das Intervall $[a, b]$ lediglich in zwei Teilintervalle $[a, \frac{a+b}{2}]$ und $[\frac{a+b}{2}, b]$, so können wir die obige Formel direkt verwenden. Wir erhalten dann die *Kepler'sche Faßregel* (Johannes Kepler, 1571 – 1630).

$$\int_a^b f(x) dx \approx \frac{1}{6} \cdot \left(f(a) + 4 \cdot f\left(\frac{a+b}{2}\right) + f(b) \right) \cdot (b - a) \quad (5.15)$$

Berechnen wir das Integral $\int_0^1 \exp(-x^2) dx$ mit dieser Regel, so erhalten wir 0.7471804290 und der Fehler ist bereits kleiner als $4 \cdot 10^{-4}$.

Unterteilen wir das Intervall $[a, b]$ in n Intervalle und ist darüber hinaus n eine gerade Zahl, so können wir die Regel 5.15 jeweils auf die beiden benachbarten Intervalle $[x_{2 \cdot i}, x_{2 \cdot i+1}]$ und $[x_{2 \cdot i+1}, x_{2 \cdot i+2}]$ anwenden, wobei der Index i über alle Elemente der Menge $\{0, \dots, (n-1)/2\}$ läuft. Setzen wir $h := \frac{b-a}{n}$ und $x_i := a + i \cdot h$, so erhalten wir die Formel

$$\begin{aligned} \int_a^b f(x) dx &\approx \frac{h}{3} \cdot \sum_{i=0}^{(n-1)/2} \left(f(x_{2 \cdot i}) + 4 \cdot f(x_{2 \cdot i+1}) + f(x_{2 \cdot i+2}) \right) \\ &= \frac{h}{3} \cdot \left(f(x_0) + 4 \cdot \sum_{i=0}^{(n-1)/2} f(x_{2 \cdot i+1}) + 2 \cdot \sum_{i=1}^{(n-1)/2} f(x_{2 \cdot i}) + f(x_n) \right) \end{aligned} \quad (5.16)$$

Die obige Formel trägt den Namen Simpson'sche Regel (Thomas Simpson, 1710 – 1761). Falls die Funktion f insgesamt viermal differenzierbar ist und falls darüber hinaus die vierte Ableitung von f der Ungleichung

$$|f^{(4)}(x)| \leq K$$

genügt, so läßt sich der Fehler, der bei der Verwendung der Simpson'schen Regel entsteht, durch

$$\frac{K}{180} \cdot \frac{(b-a)^5}{n^4}$$

abschätzen. Verdoppeln wir die Zahl n der Intervalle, so verkleinert sich der Fehler also um das 16-fache! Wählen wir beispielsweise $n = 20$ und berechnen das Integral $\int_0^1 \exp(-x^2) dx$, so erhalten wir den Wert 0.746824183 und der Fehler ist kleiner als 10^{-7} .

Aufgabe 41:

- (a) Berechnen Sie mit Hilfe der Kepler'schen Faß-Regel eine Approximation für das Integral

$$\int_0^{\frac{1}{2}} \sin(x) dx.$$

- (b) Geben Sie eine möglichst genaue Abschätzung für den Approximations-Fehler.
 (c) Vergleichen Sie ihr Ergebnis mit dem exakten Wert. ◇

Aufgabe 42: Gegenstand dieser Aufgabe ist die numerische Berechnung der Summe

$$\sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^2}.$$

Gehen Sie zur Berechnung dieser Summe in folgenden Schritten vor.

- (a) Approximieren Sie die Rest-Summe $\sum_{k=n}^{\infty} \frac{1}{k^2}$ durch ein geeignetes Integral.

Hinweis: Es gilt $f(k) = \int_{k-\frac{1}{2}}^{k+\frac{1}{2}} f(k) dt \approx \int_{k-\frac{1}{2}}^{k+\frac{1}{2}} f(t) dt.$

- (b) Berechnen Sie eine obere Abschätzung für den Approximations-Fehler, den Sie bei der Integration in Teil (a) erhalten.

Hinweis: Schätzen Sie die auftretenden Summen durch Integrale nach oben ab.

- (c) Berechnen Sie, wie groß Sie n wählen müssen, damit der Approximations-Fehler kleiner als 10^{-6} bleibt.
 (d) Geben Sie nun einen Näherungs-Wert für die Summe $\sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^2}$ an, der sich von dem exakten Ergebnis um weniger als 10^{-6} unterscheidet.

Kapitel 6

Die Kreiszahl π und die Euler'sche Zahl e sind irrational

In diesem Kapitel zeigen wir, dass sowohl die Kreiszahl π , die als Fläche eines Kreises mit dem Radius 1 definiert ist, als auch die Euler'sche Zahl e , die als Grenzwert der Reihe

$$\exp(1) := \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!}$$

festgelegt ist, irrational sind. Da der Nachweis der Irrationalität von e einfacher ist, beginnen wir damit.

6.1 Die Euler'sche Zahl e ist irrational

Nach Definition von e gilt

$$e = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!}.$$

Für alle $n \in \mathbb{N}$ definieren wir die n -te Partial-Summe s_n als

$$s_n := \sum_{k=0}^n \frac{1}{k!}.$$

Als nächstes definieren wir für alle natürlichen Zahlen $n \in \mathbb{N}$ den n -ten Rest

$$r_n := e - s_n = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!} - \sum_{k=0}^n \frac{1}{k!} = \sum_{k=n+1}^{\infty} \frac{1}{k!}$$

Offenbar gilt

$$0 < r_n, \tag{6.1}$$

denn der n -te Rest r_n enthält auf jeden Fall den Term $\frac{1}{(n+1)!}$ und der ist positiv. Wir wollen nun den n -ten Rest r_n nach oben hin abschätzen. Dazu benötigen wir zunächst die folgende Abschätzung, die für alle $k > n + 1$ gültig ist:

$$\begin{aligned} \frac{(n+1)!}{k!} &< \frac{1}{(n+1)^{k-(n+1)}} \\ \Leftrightarrow \frac{k!}{(n+1)!} &> (n+1)^{k-(n+1)} \\ \Leftrightarrow \underbrace{(n+2) \cdot (n+3) \cdot \dots \cdot (k-1) \cdot k}_{k-(n+1) \text{ Faktoren}} &> \underbrace{(n+1) \cdot \dots \cdot (n+1)}_{k-(n+1) \text{ Faktoren}} \end{aligned}$$

Die letzte Ungleichung ist richtig, denn die Faktoren auf der linken Seite haben die Form $(n+1)+i$ mit $i \in \{1, \dots, k-(n+1)\}$ und offenbar gilt

$$(n+1)+i > n+1 \quad \text{für } i \in \{1, \dots, k-(n+1)\},$$

so dass zu jedem Faktor in dem Produkt auf der linken Seite ein kleinerer Faktor auf der rechten Seite korrespondiert. Falls $k = (n+1)$ ist, gilt

$$\frac{(n+1)!}{k!} = \frac{1}{(n+1)^{k-(n+1)}} = 1,$$

was man unmittelbar durch Einsetzen bestätigen kann. Wir haben also insgesamt Folgendes gezeigt:

$$\frac{(n+1)!}{k!} < \frac{1}{(n+1)^{k-(n+1)}} \quad \text{für alle } k > n+1 \quad (6.2)$$

und für $k = n+1$ haben wir die Gleichheit beider Seiten. Nun gilt für alle $n \in \mathbb{N}$ mit $n \geq 1$ die folgende Ungleichungs-Kette:

$$\begin{aligned} r_n &= \sum_{k=n+1}^{\infty} \frac{1}{k!} \\ &= \frac{1}{(n+1)!} \cdot \sum_{k=n+1}^{\infty} \frac{(n+1)!}{k!} \\ &< \frac{1}{(n+1)!} \cdot \sum_{k=n+1}^{\infty} \frac{1}{(n+1)^{k-(n+1)}} \quad (\text{nach Gleichung (6.2)}) \\ &= \frac{1}{(n+1)!} \cdot \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{(n+1)^k} \quad (\text{Index-Verschiebung}) \\ &= \frac{1}{(n+1)!} \cdot \frac{1}{1 - \frac{1}{n+1}} \quad (\text{geometrische Reihe}) \\ &= \frac{1}{(n+1)!} \cdot \frac{1}{\frac{n+1-1}{n+1}} \quad (\text{Hauptnenner}) \\ &= \frac{1}{(n+1)!} \cdot \frac{n+1}{n} \\ &= \frac{1}{n! \cdot n} \end{aligned}$$

Multiplizieren wir die resultierende Ungleichung mit $n!$, so sehen wir, dass

$$n! \cdot r_n < \frac{1}{n}$$

gilt. Fassen wir diese Gleichung zusammen mit der Gleichung (6.1), so haben wir insgesamt

$$0 < n! \cdot r_n < \frac{1}{n} \quad \text{falls } n \geq 1 \text{ ist.} \quad (6.3)$$

Damit ist aber klar, dass der Ausdruck $n! \cdot r_n$ für $n \geq 1$ keine natürliche Zahl sein kann.

Theorem 79 Die Eulersche Zahl e ist irrational.

Beweis: Wir nehmen an, dass e rational ist. Dann gibt es natürliche Zahlen $p, q \in \mathbb{N}$ mit $q \geq 1$ und

$$e = \frac{p}{q}.$$

Wir betrachten den Ausdruck $q! \cdot r_q = q! \cdot (e - s_q)$ und setzen dort für e den Wert $\frac{p}{q}$ ein:

$$q! \cdot r_q = q! \cdot \left(\frac{p}{q} - \sum_{k=0}^q \frac{1}{k!} \right) = (q-1)! \cdot p - \sum_{k=0}^q \frac{q!}{k!} \in \mathbb{Z},$$

denn $(q-1)! \cdot p$ ist auf jeden Fall eine natürliche Zahl und für $k \leq q$ hat der Ausdruck $\frac{q!}{k!}$ die Form

$$\frac{q!}{k!} = \frac{1 \cdot 2 \cdot \dots \cdot k \cdot (k+1) \cdot (k+2) \cdot \dots \cdot (q-1) \cdot q}{1 \cdot 2 \cdot \dots \cdot k} = (k+1) \cdot (k+2) \cdot \dots \cdot (q-1) \cdot q$$

und das ist ebenfalls eine natürliche Zahl. Damit haben wir aber einen Widerspruch, denn die Aussagen

$$0 < q! \cdot r_q < 1 \quad \text{und} \quad q! \cdot r_q \in \mathbb{Z}$$

sind unvereinbar. □

6.2 Die Kreiszahl π ist irrational

Zur Vorbereitung des Beweises benötigen wir das folgende Lemma.

Lemma 80 Für alle natürlichen Zahlen n gilt:

$$\int_0^\pi f(x) \cdot \sin(x) dx = \sum_{k=0}^n (-1)^k \cdot (f^{(2k)}(\pi) + f^{(2k)}(0)) + (-1)^{n+1} \cdot \int_0^\pi f^{(2n+2)}(x) \cdot \sin(x) dx.$$

Beweis: Zur Abkürzung definieren wir

$$I := \int_0^\pi f(x) \cdot \sin(x) dx$$

und

$$S_n := \sum_{k=0}^n (-1)^k \cdot (f^{(2k)}(\pi) + f^{(2k)}(0)) + (-1)^{n+1} \cdot \int_0^\pi f^{(2n+2)}(x) \cdot \sin(x) dx.$$

Die Behauptung

$$I = S_n$$

wird nun durch Induktion nach n bewiesen. Dabei werden wir sowohl im Induktions-Anfang als auch im Induktions-Schritt zwei partielle Integrationen durchführen.

I.A.: $n = 0$.

Nach Definition von I gilt

$$I = \int_0^\pi f(x) \cdot \sin(x) dx$$

Wir integrieren partiell und setzen $u(x) = f(x)$ und $v'(x) = \sin(x)$. Dann gilt $u'(x) = f'(x)$ und $v(x) = -\cos(x)$. Also haben wir

$$I = -f(x) \cdot \cos(x) \Big|_0^\pi + \int_0^\pi f'(x) \cdot \cos(x) dx.$$

Für den ersten Summanden auf der rechten Seite dieser Gleichung finden wir

$$-f(x) \cdot \cos(x) \Big|_0^\pi = -f(\pi) \cdot \cos(\pi) + f(0) \cdot \cos(0) = f(\pi) + f(0).$$

Um das verbleibende Integral zu berechnen führen wir eine erneute partielle Integration durch, bei der wir diesmal $u(x) = f'(x)$ und $v'(x) = \cos(x)$ setzen. Dann gilt $u'(x) = f^{(2)}(x)$

und $v(x) = \sin(x)$. Damit finden wir für das Integral I den Wert

$$I = f(\pi) + f(0) - \int_0^\pi f^{(2)}(x) \cdot \sin(x) dx.$$

Auf der anderen Seite haben wir

$$\begin{aligned} S_0 &= \sum_{k=0}^0 (-1)^k \cdot (f^{(2k)}(\pi) + f^{(2k)}(0)) + (-1)^{0+1} \cdot \int_0^\pi f^{(2 \cdot 0 + 2)}(x) \cdot \sin(x) dx \\ &= (-1)^0 \cdot (f^{(0)}(\pi) + f^{(0)}(0)) - \int_0^\pi f^{(2)}(x) \cdot \sin(x) dx \\ &= f(\pi) + f(0) - \int_0^\pi f^{(2)}(x) \cdot \sin(x) dx \\ &= I. \end{aligned}$$

I.S.: $n \mapsto n + 1$

Zur Abkürzung definieren wir

$$J_n = \int_0^\pi f^{(2n+2)}(x) \cdot \sin(x) dx$$

Wir berechnen J_n durch partielle Integration und setzen $u(x) := f^{(2n+2)}(x)$ und $v'(x) := \sin(x)$. Dann haben wir $u'(x) = f^{(2n+3)}(x)$ und $v(x) = -\cos(x)$. Das liefert

$$J_n = -f^{(2n+2)}(x) \cdot \cos(x) \Big|_0^\pi + \int_0^\pi f^{(2n+3)}(x) \cdot \cos(x) dx.$$

Wegen $\cos(\pi) = -1$ und $\cos(0) = 1$ vereinfacht sich der erste Summand auf der rechten Seite wie folgt:

$$-f^{(2n+2)}(x) \cdot \cos(x) \Big|_0^\pi = f^{(2n+2)}(\pi) + f^{(2n+2)}(0).$$

Das auf der rechten Seite der obigen Gleichung verbleibende Integral berechnen wir durch eine weitere partielle Integration. Diesmal setzen wir $u(x) = f^{(2n+3)}(x)$ und $v'(x) = \cos(x)$. Dann haben wir $u'(x) = f^{(2n+4)}(x)$ und $v(x) = \sin(x)$ und für das Integral finden wir

$$\begin{aligned} \int_0^\pi f^{(2n+3)}(x) \cdot \cos(x) dx &= f^{(2n+3)}(x) \cdot \sin(x) \Big|_0^\pi - \int_0^\pi f^{(2n+4)}(x) \cdot \sin(x) dx \\ &= - \int_0^\pi f^{(2n+4)}(x) \cdot \sin(x) dx \end{aligned}$$

Insgesamt haben wir damit für J_n den Ausdruck

$$\begin{aligned} J_n &= f^{(2n+2)}(\pi) + f^{(2n+2)}(0) - \int_0^\pi f^{(2n+4)}(x) \cdot \sin(x) dx \\ &= f^{(2n+2)}(\pi) + f^{(2n+2)}(0) - J_{n+1} \end{aligned}$$

gefunden. Jetzt rechnen wir wie folgt:

$$\begin{aligned} I &\stackrel{IV}{=} \sum_{k=0}^n (-1)^k \cdot (f^{(2k)}(\pi) + f^{(2k)}(0)) + (-1)^{n+1} \cdot J_n \\ &= \sum_{k=0}^n (-1)^k \cdot (f^{(2k)}(\pi) + f^{(2k)}(0)) + (-1)^{n+1} \cdot (f^{(2n+2)}(\pi) + f^{(2n+2)}(0) - J_{n+1}) \\ &= \sum_{k=0}^{n+1} (-1)^k \cdot (f^{(2k)}(\pi) + f^{(2k)}(0)) + (-1)^{n+2} \cdot J_{n+1} = S_{n+1} \end{aligned}$$

Damit haben wir gezeigt, dass $I = S_{n+1}$ gilt und die Induktion ist abgeschlossen. \square

Theorem 81 Die Kreiszahl π ist irrational.

Beweis: Wir führen den Beweis indirekt und nehmen an, dass $\pi \in \mathbb{Q}$ ist. Dann gibt es Zahlen $p, q \in \mathbb{N}$ mit

$$\pi = \frac{p}{q}.$$

Für beliebige $n \in \mathbb{N}$ definieren wir das Polynom $g_n(x)$ wie folgt:

$$g_n(x) := \frac{1}{n!} \cdot x^n \cdot (p - q \cdot x)^n.$$

Es gilt

$$\begin{aligned} g_n(\pi - x) &= \frac{1}{n!} \cdot \left(\frac{p}{q} - x \right)^n \cdot \left(p - q \cdot \left(\frac{p}{q} - x \right) \right)^n \\ &= \frac{1}{n!} \cdot \left(\frac{p}{q} - x \right)^n \cdot (q \cdot x)^n \\ &= \frac{1}{n!} \cdot (p - q \cdot x)^n \cdot x^n \\ &= g_n(x) \end{aligned}$$

Diese Gleichung überträgt sich natürlich auf die Ableitungen und daher haben wir

$$g_n^{(k)}(\pi - x) = (-1)^k \cdot g_n^{(k)}(x).$$

Offenbar ist g_n ein Polynom vom Grad $2 \cdot n$ und damit ist klar, dass $g_n^{(2n+2)}(x) = 0$ ist. Setzen wir in der Behauptung des letzten Lemmas für f die Funktion $g_n(x)$ ein, so folgt daher

$$\int_0^\pi g_n(x) \cdot \sin(x) dx = \sum_{k=0}^n (-1)^k \cdot \left(g_n^{(2k)}(\pi) + g_n^{(2k)}(0) \right).$$

Wir zeigen, dass alle Summanden in der Summe auf der rechten Seite dieser Gleichung ganze Zahlen sind. Dabei reicht es aus, dies für die Summanden der Form $g_n^{(2k)}(0)$ zu zeigen, denn es gilt

$$g_n^{(2k)}(\pi) = (-1)^{2 \cdot k} \cdot g_n^{(2k)}(\pi - \pi) = g_n^{(2k)}(0).$$

Wir zeigen mit Hilfe einer Fallunterscheidung, dass $g_n^{(k)}(0) \in \mathbb{N}$ für alle $k \in \mathbb{N}$ gilt.

(1) Fall: $k < n$.

Da das Polynom $g_n(x)$ die Form

$$g_n(x) = \frac{1}{n!} \cdot \sum_{i=n}^{2 \cdot n} c_i \cdot x^i$$

mit Koeffizienten $c_i \in \mathbb{Z}$ hat, folgt, dass für $k < n$

$$g_n^{(k)}(x) = \frac{1}{n!} \cdot \sum_{i=n}^{2 \cdot n} \frac{i!}{(i-k)!} \cdot c_i \cdot x^{i-k}$$

gilt. Jeder Term dieser Summe enthält mindestens den Faktor x . Setzen wir hier für x den Wert 0 ein, so wird daher jeder Term in der Summe 0. Damit gilt

$$g_n^{(k)}(0) = 0 \in \mathbb{N}.$$

(2) Fall: $k \geq n$.

Diesmal verschwinden beim Ableiten alle Summanden mit Index $i < k$. Wir haben also

$$\begin{aligned}
g_n^{(k)}(x) &= \frac{1}{n!} \cdot \sum_{i=k}^{2 \cdot n} \frac{i!}{(i-k)!} \cdot c_i \cdot x^{i-k} \\
&= \sum_{i=k}^{2 \cdot n} \frac{k!}{n!} \cdot \frac{i!}{k! \cdot (i-k)!} \cdot c_i \cdot x^{i-k} \\
&= \sum_{i=k}^{2 \cdot n} \frac{k!}{n!} \cdot \binom{i}{k} \cdot c_i \cdot x^{i-k}
\end{aligned}$$

Für $x = 0$ folgt dann

$$g_n^{(k)}(0) = \frac{k!}{n!} \cdot \binom{k}{k} \cdot c_k = \frac{k!}{n!} \cdot c_k \in \mathbb{Z},$$

denn wenn $k \geq n$ ist, ist $\frac{k!}{n!}$ eine natürliche Zahl.

Insgesamt wissen wir jetzt, dass das Integral

$$I_n := \int_0^\pi g_n(x) \cdot \sin(x) dx$$

für alle $n \in \mathbb{N}$ eine ganze Zahl ist. Für alle $x \in [0, \pi]$ gilt nun

$$0 \leq \sin(x) \quad \text{und} \quad 0 \leq g_n(x).$$

Also muss auch

$$0 < I_n$$

gelten. Die Ungleichung ist echt, denn die beiden Funktionen $\sin(x)$ und $g_n(x)$ haben nur bei $x = 0$ und $x = \pi$ eine Nullstelle. Außerdem gilt für alle $x \in [0, \pi]$

$$\sin(x) \leq 1 \quad \text{und} \quad g_n(x) \leq \frac{1}{n!} \cdot \pi^n \cdot p^n.$$

Die letzte dieser beiden Ungleichungen folgt aus der Tatsache, dass einerseits $x \leq \pi$ und andererseits $p - q \cdot x \leq p$ ist. Aus den beiden oberen Ungleichungen folgt durch Intergration

$$0 \leq I_n \leq \pi \cdot \frac{\pi^n \cdot p^n}{n!}$$

Nun gilt

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \pi \cdot \frac{\pi^n \cdot p^n}{n!} = 0$$

Daher gibt es ein $n \in \mathbb{N}$, so dass $\pi \cdot \frac{\pi^n \cdot p^n}{n!} < 1$ ist und für dieses n haben wir

$$0 < I_n < 1.$$

Das ist aber ein Widerspruch dazu, dass wir oben nachgewiesen haben, dass I_n eine ganze Zahl ist. \square

6.3 Transzendente Zahlen

Definition 82 (Algebraische Zahlen)

Eine Zahl $r \in \mathbb{R}$ heißt *algebraisch* genau dann, wenn es ein Polynom

$$p(x) = \sum_{i=0}^n a_i \cdot x^i \quad \text{mit } a_i \in \mathbb{Z} \text{ für alle } i = 0, 1, \dots, n$$

gibt, so dass r Nullstelle des Polynoms p ist, es muss also gelten

$$p(r) = \sum_{i=0}^n a_i \cdot r^i = 0. \quad \diamond$$

Bei der obigen Definition ist die Forderung, dass die Koeffizienten a_i ganze Zahlen sind, entscheidend, denn sonst könnten wir zu beliebigem $r \in \mathbb{R}$ einfach das Polynom

$$p_r(x) := x - r$$

definieren und offenbar gilt $p_r(r) = 0$. Ein solches Polynom ist zur Definition einer algebraischen Zahl aber nur zugelassen, wenn r eine ganze Zahl ist. \diamond

Beispiel: Jede rationale Zahl r ist eine algebraische Zahl, denn wenn $r \in \mathbb{Q}$ ist, dann gibt es ganze Zahlen a und b mit $b \neq 0$, so dass

$$r = \frac{a}{b}$$

gilt. Damit können wir ein Polynom p als

$$p(x) := a - b \cdot x$$

definieren. Für dieses Polynom gilt dann

$$p(r) = p\left(\frac{a}{b}\right) = a - b \cdot \frac{a}{b} = a - a = 0$$

und damit ist gezeigt, dass jede rationale Zahl r algebraisch ist. Der Begriff der algebraischen Zahlen ist also eine Verallgemeinerung des Begriffs der rationalen Zahlen. \diamond

Beispiel: Die Zahl $\sqrt{2}$ ist eine algebraische Zahl, denn wenn wir das Polynom p als

$$p(x) := x^2 - 2$$

definieren, gilt offenbar

$$p(\sqrt{2}) = (\sqrt{2})^2 - 2 = 2 - 2 = 0.$$

Dieses Beispiel zeigt, dass es sich bei dem Begriff der algebraischen Zahlen um eine echte Verallgemeinerung des Begriffs der rationalen Zahlen handelt, denn wir haben ja bereits im ersten Semester gesehen, dass die Zahl $\sqrt{2}$ keine rationale Zahl ist. \diamond

Aufgabe 43: Zeigen Sie, dass die Zahl $\sqrt{2} + \sqrt{3}$ eine algebraische Zahl ist. Zeigen Sie außerdem, dass diese Zahl keine rationale Zahl ist. \diamond

Definition 83 (Transzendente Zahl) Eine Zahl $x \in \mathbb{R}$ ist genau dann *transzendent*, wenn x nicht algebraisch ist.

Es lässt sich zeigen, dass die Menge aller Polynome mit ganzzahligen Koeffizienten abzählbar ist. Damit ist natürlich auch die Menge der algebraischen Zahlen abzählbar. Da die Menge der reellen Zahlen überabzählbar ist, muss es also sehr viele reelle Zahlen geben, die transzendent sind. Allerdings ist der Nachweis der Transzendenz einer Zahl in der Regel recht aufwändig.

Theorem 84 (Charles Hermite, 1873)

Die Eulersche Zahl e ist transzendent.

Theorem 85 (Ferdinand von Lindemann, 1882)

Die Kreiszahl π ist transzendent.

Der Nachweis dieser beiden Theoreme gehört zu den wichtigsten mathematischen Erkenntnissen des 19ten Jahrhunderts. Für diese Vorlesung sind diese Beweise zu aufwändig, wir könnten

diese Beweise aber mit den uns jetzt zur Verfügung stehenden Mitteln führen.

Aufgabe 44: Zeigen Sie, dass für alle natürlichen Zahlen $n \in \mathbb{N}$

$$\int_0^\infty t^n \cdot e^{-t} dt = n!$$

gilt.

Bemerkung: Die letzte Gleichung motiviert die folgende Definition der *Gamma-Funktion*. Wir setzen

$$\Gamma(x) := \int_0^\infty t^{x-1} \cdot e^{-t} dt.$$

Mit dieser Definition gilt

$$\Gamma(n+1) = n!$$

und daher können wir die Gamma-Funktion als eine Erweiterung der Fakultäts-Funktion auf die natürlichen Zahlen auffassen.

Kapitel 7

Fourier-Analyse

Bei der Fourier-Analyse (Jean Baptiste Joseph Fourier; 1768 - 1830) zerlegen wir eine periodische Funktion in Sinus-Schwingungen verschiedener Frequenzen. Dieses Verfahren wird in der Praxis zur Ton- und Bild-Verarbeitung eingesetzt. Außerdem ist die Fourier-Analyse ein wichtiges Hilfsmittel zur Lösung von Differenzial-Gleichungen. Im Rahmen dieser Vorlesung werden wir die Fourier-Analyse allerdings nur zur Berechnung unendlichen Reihen einsetzen, denn für die anderen Anwendungen reicht die Zeit nicht aus.

Bei der Fourier-Analyse gehen wir davon aus, dass eine Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ gegeben ist, die *periodisch* mit der Periode $2 \cdot \pi$ ist, d. h. es gilt

$$\forall x \in \mathbb{R} : f(x + 2 \cdot \pi) = f(x).$$

Ein triviales Beispiel für eine periodische Funktion ist die konstante Funktion $x \mapsto c$. Das typische Beispiel einer periodischen Funktion ist die Funktion $x \mapsto \sin(x)$, denn es gilt $\sin(x + 2 \cdot \pi) = \sin(x)$. Genauso ist auch die Funktion $x \mapsto \cos(x)$ periodisch mit der Periode $2 \cdot \pi$. Weitere Beispiele für periodische Funktionen sind die Funktionen

$$x \mapsto \sin(n \cdot x) \quad \text{und} \quad x \mapsto \cos(n \cdot x) \quad \text{für } n \in \mathbb{N}.$$

Aus diesen Funktionen lassen sich weitere periodische Funktionen durch Linear-Kombination erhalten, denn wenn f und g zwei periodische Funktionen mit der Periode $2 \cdot \pi$ sind, so ist natürlich auch die Funktion

$$x \mapsto \alpha \cdot f(x) + \beta \cdot g(x) \quad \text{für } \alpha, \beta \in \mathbb{R}$$

eine periodische Funktion der Periode $2 \cdot \pi$. Die grundlegende Idee bei der Fourier-Analyse besteht nun darin, dass sich jede halbwegs normale¹ periodische Funktion als unendliche Linear-Kombination der oben vorgestellten Funktionen darstellen läßt. Genauer definieren wir folgendes:

Definition 86 (Fourier-Reihe) Es seien $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und $(b_n)_{n \in \mathbb{N} \setminus \{0\}}$ Folgen reeller Zahlen. Dann bezeichnen wir den Ausdruck

$$\frac{1}{2} \cdot a_0 + \sum_{k=1}^{\infty} a_k \cdot \cos(k \cdot x) + \sum_{k=1}^{\infty} b_k \cdot \sin(k \cdot x) \tag{7.1}$$

als die mit den Folgen $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$ und $(b_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gebildete Fourier-Reihe.

7.1 Berechnung der Fourier-Koeffizienten

Die zentrale Frage bei der *Fourier-Analyse* ist es, für eine gegebene periodische Funktion f die *Fourier-Koeffizienten* a_k und b_k zu berechnen. Ist f eine periodische Funktion mit der Periode

¹ Es gibt periodische Funktionen, die sich nicht in einer Fourier-Reihe entwickeln lassen. Diese Funktionen sind aber relativ exotisch, so dass wir uns damit nicht weiter befassen.

$2 \cdot \pi$ und gilt

$$f(x) = \frac{1}{2} \cdot a_0 + \sum_{k=1}^{\infty} a_k \cdot \cos(k \cdot x) + \sum_{k=1}^{\infty} b_k \cdot \sin(k \cdot x), \quad (7.2)$$

so können wir den Koeffizienten a_0 dadurch gewinnen, dass wir die Funktion $f(x)$ in dem Intervall $[0, 2 \cdot \pi]$ integrieren. Wir erhalten dann

$$\int_0^{2 \cdot \pi} f(x) dx = \frac{1}{2} \cdot a_0 \cdot \int_0^{2 \cdot \pi} 1 dx + \int_0^{2 \cdot \pi} \sum_{k=1}^{\infty} a_k \cdot \cos(k \cdot x) dx + \int_0^{2 \cdot \pi} \sum_{k=1}^{\infty} b_k \cdot \sin(k \cdot x) dx$$

Das erste Integral auf der rechten Seite können wir ausführen, die anderen Integrale vertauschen wir mit den unendlichen Reihen². Das liefert

$$\int_0^{2 \cdot \pi} f(x) dx = \frac{1}{2} \cdot a_0 \cdot 2 \cdot \pi + \sum_{k=1}^{\infty} a_k \cdot \int_0^{2 \cdot \pi} \cos(k \cdot x) dx + \sum_{k=1}^{\infty} b_k \cdot \int_0^{2 \cdot \pi} \sin(k \cdot x) dx \quad (7.3)$$

Nun gilt für alle $k \in \mathbb{N}$ mit $k \geq 1$

$$\begin{aligned} \int_0^{2 \cdot \pi} \sin(k \cdot x) dx &= \left. \frac{-1}{k} \cdot \cos(k \cdot x) \right|_0^{2 \cdot \pi} \\ &= \frac{-1}{k} \cdot (\cos(k \cdot 2 \cdot \pi) - \cos(0)) = \frac{-1}{k} \cdot (1 - 1) = 0, \end{aligned} \quad (7.4)$$

denn $\cos(k \cdot 2 \cdot \pi) = \cos(0) = 1$. Genauso sehen wir für alle $k \geq 1$

$$\int_0^{2 \cdot \pi} \cos(k \cdot x) dx = \left. \frac{1}{k} \cdot \sin(k \cdot x) \right|_0^{2 \cdot \pi} = \frac{1}{k} \cdot (\sin(k \cdot 2 \cdot \pi) - \sin(0)) = 0, \quad (7.5)$$

denn $\sin(k \cdot 2 \cdot \pi) = \sin(0) = 0$. Setzen wir die Gleichungen (7.5) und (7.4) in Gleichung (7.2) ein, so erhalten wir die Gleichung

$$\int_0^{2 \cdot \pi} f(x) dx = \pi \cdot a_0 \quad \text{bzw.} \quad a_0 = \frac{1}{\pi} \int_0^{2 \cdot \pi} f(x) dx \quad (7.6)$$

Damit haben wir den Koeffizienten a_0 bestimmt. Um die Koeffizienten a_k für $k \geq 0$ zu bestimmen, multiplizieren wir die Gleichung (7.2) mit $\cos(n \cdot x)$, wobei $n \in \mathbb{N}$ mit $n \geq 1$ ist. Anschließend integrieren wir über das Intervall $[0, 2 \cdot \pi]$. Dann haben wir

$$\begin{aligned} \int_0^{2 \cdot \pi} f(x) \cdot \cos(n \cdot x) dx &= \frac{1}{2} \cdot a_0 \int_0^{2 \cdot \pi} \cos(n \cdot x) dx \\ &+ \int_0^{2 \cdot \pi} \cos(n \cdot x) \cdot \sum_{k=1}^{\infty} a_k \cdot \cos(k \cdot x) dx \\ &+ \int_0^{2 \cdot \pi} \cos(n \cdot x) \cdot \sum_{k=1}^{\infty} b_k \cdot \sin(k \cdot x) dx \end{aligned}$$

Vertauschen wir Integration und Summation, so erhalten wir

$$\begin{aligned} \int_0^{2 \cdot \pi} f(x) \cdot \cos(n \cdot x) dx &= \frac{1}{2} \cdot a_0 \int_0^{2 \cdot \pi} \cos(n \cdot x) dx \\ &+ \sum_{k=1}^{\infty} a_k \cdot \int_0^{2 \cdot \pi} \cos(n \cdot x) \cdot \cos(k \cdot x) dx \\ &+ \sum_{k=1}^{\infty} b_k \cdot \int_0^{2 \cdot \pi} \cos(n \cdot x) \cdot \sin(k \cdot x) dx \end{aligned} \quad (7.7)$$

² Eine genaue Analyse, wann diese Vertauschung zulässig ist, geht über den Rahmen dieser Vorlesung hinaus.

Wir berechnen als nächstes die Integrale, die in dieser Formel auftreten. Das erste Integral hat nach Gleichung (7.5) den Wert 0. Zur Berechnung der anderen Integrale definieren wir

$$I_{n,k} := \int_0^{2\cdot\pi} \cos(n\cdot x) \cdot \cos(k\cdot x) dx \quad \text{und} \quad J_{n,k} := \int_0^{2\cdot\pi} \sin(n\cdot x) \cdot \sin(k\cdot x) dx$$

Wir berechnen $I_{n,k}$ durch partielle Integration. Für $n \neq 0$ gilt

$$\begin{aligned} I_{n,k} &= \int_0^{2\cdot\pi} \cos(n\cdot x) \cdot \cos(k\cdot x) dx \\ &= \frac{1}{n} \cdot \sin(n\cdot x) \cdot \cos(k\cdot x) \Big|_0^{2\cdot\pi} + \frac{k}{n} \cdot \int_0^{2\cdot\pi} \sin(n\cdot x) \cdot \sin(k\cdot x) dx \\ &= \frac{k}{n} \cdot J_{n,k}. \end{aligned}$$

Damit haben wir $I_{n,k}$ auf $J_{n,k}$ zurück geführt. Jetzt berechnen wir $J_{n,k}$ durch partielle Integration. Für $n \neq 0$ gilt

$$\begin{aligned} J_{n,k} &= \int_0^{2\cdot\pi} \sin(n\cdot x) \cdot \sin(k\cdot x) dx \\ &= \frac{-1}{n} \cdot \cos(n\cdot x) \cdot \sin(k\cdot x) \Big|_0^{2\cdot\pi} + \frac{k}{n} \cdot \int_0^{2\cdot\pi} \cos(n\cdot x) \cdot \cos(k\cdot x) dx \\ &= \frac{k}{n} \cdot I_{n,k} \end{aligned}$$

Damit haben wir die Berechnung von $J_{n,k}$ auf $I_{n,k}$ zurück geführt. Insgesamt haben wir die Gleichungen

$$I_{n,k} = \frac{k}{n} \cdot J_{n,k} \quad \text{und} \quad J_{n,k} = \frac{k}{n} \cdot I_{n,k}$$

gefunden. Setzen wir die zweite Gleichung in die erste Gleichung ein, so folgt

$$I_{n,k} = \frac{k^2}{n^2} \cdot I_{n,k} \quad \text{also} \quad \left(1 - \frac{k^2}{n^2}\right) \cdot I_{n,k} = 0.$$

Falls $k \neq n$ ist, folgt daraus sofort

$$I_{n,k} = 0 \quad \text{und} \quad J_{n,k} = 0 \quad \text{für } n \neq k.$$

In dem Fall $k = n$ hat die bisherige Rechnung uns nicht viel weiter gebracht. In diesem Fall wissen wir lediglich, dass $I_{n,n} = J_{n,n}$ gilt. Hier hilft uns eine Addition weiter:

$$\begin{aligned} 2 \cdot I_{n,n} &= I_{n,n} + J_{n,n} \\ &= \int_0^{2\cdot\pi} \cos(n\cdot x) \cdot \cos(n\cdot x) dx + \int_0^{2\cdot\pi} \sin(n\cdot x) \cdot \sin(n\cdot x) dx \\ &= \int_0^{2\cdot\pi} \cos^2(n\cdot x) + \sin^2(n\cdot x) dx \\ &= \int_0^{2\cdot\pi} 1 dx \\ &= 2 \cdot \pi \end{aligned}$$

Teilen wir beide Seiten der Gleichung durch 2, so erhalten wir als Ergebnis

$$I_{n,n} = \int_0^{2\cdot\pi} \cos(n\cdot x) \cdot \cos(n\cdot x) dx = \pi.$$

Wegen $J_{n,n} = I_{n,n}$ gilt auch

$$J_{n,n} = \int_0^{2\cdot\pi} \sin(n\cdot x) \cdot \sin(n\cdot x) dx = \pi.$$

Insgesamt haben wir also

$$I_{n,k} = J_{n,k} = \pi \cdot \delta_{n,k},$$

wobei $\delta_{n,k}$ das früher definierte Kronecker-Delta bezeichnet. Um die Gleichung 7.7 nach den Koeffizienten a_k auflösen zu können, müssen wir noch die Integrale

$$H_{n,k} := \int_0^{2\cdot\pi} \cos(n\cdot x) \cdot \sin(k\cdot x) dx$$

berechnen. Wir könnten dieses Integral auf die selbe Art berechnen, mit der wir oben die Integrale $\int_0^{2\cdot\pi} \cos(n\cdot x) \cdot \cos(k\cdot x) dx$ und $\int_0^{2\cdot\pi} \sin(n\cdot x) \cdot \sin(k\cdot x) dx$ berechnet haben. Es gibt aber noch einen anderen Weg, den wir jetzt aufzeigen. Aus dem Additions-Theorem für die Sinus-Funktion

$$\sin(\alpha + \beta) = \sin(\alpha) \cdot \cos(\beta) + \cos(\alpha) \cdot \sin(\beta)$$

folgt sofort

$$\sin(\alpha) \cdot \cos(\beta) = \frac{1}{2} \cdot \sin(\alpha + \beta) + \frac{1}{2} \cdot \sin(\alpha - \beta).$$

Damit gilt

$$\begin{aligned} H_{n,k} &= \int_0^{2\cdot\pi} \cos(n\cdot x) \cdot \sin(k\cdot x) dx \\ &= \frac{1}{2} \cdot \int_0^{2\cdot\pi} \sin((k+n)\cdot x) dx + \frac{1}{2} \cdot \int_0^{2\cdot\pi} \sin((k-n)\cdot x) dx \\ &= 0 \end{aligned}$$

nach Gleichung (7.4). Für $n > 0$ schreibt sich damit die Formel 7.7 wie folgt

$$\begin{aligned} \int_0^{2\cdot\pi} f(x) \cdot \cos(n\cdot x) dx &= \frac{1}{2} \cdot a_0 \int_0^{2\cdot\pi} \cos(n\cdot x) dx \\ &+ \sum_{k=1}^{\infty} a_k \cdot \int_0^{2\cdot\pi} \cos(n\cdot x) \cdot \cos(k\cdot x) dx \\ &+ \sum_{k=1}^{\infty} b_k \cdot \int_0^{2\cdot\pi} \cos(n\cdot x) \cdot \sin(k\cdot x) dx \\ &= 0 + \sum_{k=1}^{\infty} a_k \cdot I_{n,k} + \sum_{k=1}^{\infty} b_k \cdot H_{n,k} \\ &= \sum_{k=1}^{\infty} a_k \cdot \pi \cdot \delta_{n,k} + \sum_{k=1}^{\infty} b_k \cdot 0 \\ &= a_n \cdot \pi \end{aligned}$$

Damit haben wir für den Fourier-Koeffizienten a_n die Formel

$$a_n = \frac{1}{\pi} \cdot \int_0^{2\cdot\pi} f(x) \cdot \cos(n\cdot x) dx \quad (7.8)$$

gefunden. Vergleichen wir diese Formel mit der Formel 7.6, so sehen wir, dass diese Gleichung auch für $n = 0$ richtig ist. Um die Koeffizienten b_n zu berechnen, multiplizieren wir die Gleichung 7.2 mit $\sin(n \cdot x)$ und integrieren über das Intervall $[0, 2 \cdot \pi]$. Dann erhalten wir nach einer Rechnung, die ganz analog zur Berechnung der Koeffizienten a_k verläuft, das Ergebnis

$$b_n = \frac{1}{\pi} \int_0^{2 \cdot \pi} f(x) \cdot \sin(n \cdot x) dx. \quad (7.9)$$

7.2 Konvergenz

Wir müssen noch die Frage beantworten, für welche Funktionen f die mit Hilfe der Gleichungen (7.8) (7.9) und (7.2) aufgestellte Fourier-Reihe gegen f konvergiert. Wir wollen uns mit einem Satz begnügen, der im wesentlichen auf Dirichlet (Johann Peter Gustav Lejeune Dirichlet; 1805 - 1859) zurück geht. Zuvor benötigen wir noch zwei Definitionen.

Definition 87 (Einschränkung einer Funktion) Ist $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ eine Funktion und ist $[a, b]$ ein nicht-leeres Intervall, so definieren wir die *Einschränkung* von f auf $[a, b]$ als die Funktion

$$f \upharpoonright_{[a,b]} : [a, b] \rightarrow \mathbb{R} \quad \text{mit} \quad f \upharpoonright_{[a,b]}(x) = f(x) \quad \text{für alle } x \in [a, b].$$

Definition 88 (stetig differenzierbar) Eine Funktion $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ ist *stetig differenzierbar* falls f differenzierbar ist und außerdem die Ableitung $f' : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ stetig ist.

Definition 89 (stückweise stetig differenzierbar) Eine Funktion $f : [0, 2\pi] \rightarrow \mathbb{R}$ ist *stückweise stetig differenzierbar* falls es Zahlen x_0, x_1, \dots, x_n gibt mit

$$0 = x_0 \leq x_1 \leq x_2 \leq \dots \leq x_{n-1} \leq x_n = 2 \cdot \pi$$

gibt, so dass für alle $i = 1, \dots, n$ gilt:

$$f \upharpoonright_{[x_{i-1}, x_i]} \text{ ist stetig differenzierbar.}$$

Ein Beispiel für eine stückweise stetige Funktion sehen Sie in Abbildung 7.1. Die Ableitung dieser Funktion weist in den Punkten $0, \pi$ und $-\pi$ Sprünge auf.

Satz 90 Es gelte

- (1) $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ ist stetig mit der Periode $2 \cdot \pi$,
- (2) $f \upharpoonright_{[0, 2\pi]}$ ist stückweise stetig differenzierbar,

$$(3) \quad a_k = \frac{1}{\pi} \cdot \int_0^{2 \cdot \pi} f(x) \cdot \cos(k \cdot x) dx \quad \text{und} \quad b_k = \frac{1}{\pi} \cdot \int_0^{2 \cdot \pi} f(x) \cdot \sin(k \cdot x) dx,$$

dann gilt

$$f(x) = \frac{1}{2} \cdot a_0 + \sum_{k=1}^{\infty} a_k \cdot \cos(k \cdot x) + \sum_{k=1}^{\infty} b_k \cdot \sin(k \cdot x).$$

Der Beweis dieses Satzes benötigt Hilfsmittel, die im Rahmen der Vorlesung nicht eingeführt werden können.

7.3 Beispiele

Um es gleich bei der Berechnung der Fourier-Koeffizienten einfacher zu haben, definieren wir für eine Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ die Begriffe *gerade* und *ungerade*:

- (1) f ist *gerade* g.d.w. $\forall x \in \mathbb{R} : f(-x) = f(x)$.

(2) f ist *ungerade* g.d.w. $\forall x \in \mathbb{R} : f(-x) = -f(x)$.

Ist die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ ungerade und ist f integrierbar, so gilt für beliebige Zahlen a

$$\int_{-a}^a f(x) dx = 0. \quad (7.10)$$

Beweis: Es gilt

$$\int_{-a}^a f(x) dx = \int_{-a}^0 f(x) dx + \int_0^a f(x) dx.$$

In dem Integral über das Intervall $[-a, 0]$ führen wir die Variablen-Transformation $y = -x$ durch. Dann gilt $dy = -dx$, und $y(-a) = a$, $y(0) = 0$. Damit gilt

$$\int_{-a}^0 f(x) dx = - \int_a^0 f(-y) dy = \int_0^a f(-y) dy = - \int_0^a f(y) dy = - \int_0^a f(x) dx$$

Also haben wir insgesamt

$$\int_{-a}^a f(x) dx = \int_{-a}^0 f(x) dx + \int_0^a f(x) dx = - \int_0^a f(x) dx + \int_0^a f(x) dx = 0. \quad \square$$

Ist die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ gerade, so kann ein Integral über ein zum Punkt $x = 0$ symmetrisches Intervall wie folgt vereinfacht werden:

$$\int_{-a}^a f(x) dx = 2 \cdot \int_0^a f(x) dx. \quad (7.11)$$

Aufgabe 45: Beweisen Sie die Gleichung 7.11.

Satz 91 Ist die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ periodisch mit der Periode $2 \cdot \pi$, so gilt

$$\int_0^{2 \cdot \pi} f(x) dx = \int_{-\pi}^{\pi} f(x) dx \quad (7.12)$$

Aufgabe 46: Beweisen Sie den letzten Satz.

Die letzten beiden Gleichungen können wir zusammenfassen.

Korollar 92 Ist die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ einerseits periodisch mit der Periode $2 \cdot \pi$ und andererseits ungerade, so gilt

$$\int_0^{2 \cdot \pi} f(x) dx = 0 \quad (7.13)$$

Beweis: Es gilt

$$\int_0^{2 \cdot \pi} f(x) dx = \int_{-\pi}^{\pi} f(x) dx = 0.$$

Korollar 93 Ist die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ einerseits periodisch mit der Periode $2 \cdot \pi$ und andererseits gerade, so gilt

$$\int_0^{2 \cdot \pi} f(x) dx = 2 \cdot \int_0^{\pi} f(x) dx \quad (7.14)$$

Beweis: Es gilt

$$\int_0^{2\pi} f(x) dx = \int_{-\pi}^{\pi} f(x) dx = 2 \cdot \int_0^{\pi} f(x) dx.$$

7.3.1 Fourier-Analyse der Sägezahn-Funktion

Wir berechnen als erstes die Fourier-Reihe für die *Sägezahn-Funktion* $s : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, die im Intervall $[0, 2 \cdot \pi]$ wie folgt definiert ist:

$$s(x) = \begin{cases} x & \text{falls } x \leq \pi, \\ 2 \cdot \pi - x & \text{falls } x \geq \pi. \end{cases}$$

Diese Funktion wird periodisch auf ganz \mathbb{R} fortgesetzt. Abbildung 7.1 zeigt diese Funktion. Wir berechnen nun die Fourier-Koeffizienten dieser Funktion.

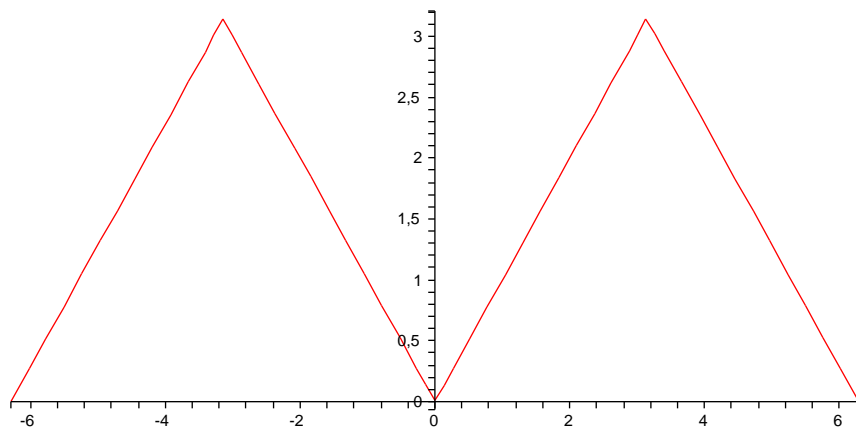


Abbildung 7.1: Die Sägezahn-Funktion.

(1) Die Koeffizienten a_n ergeben sich als

$$a_n = \frac{1}{\pi} \cdot \int_0^{2\pi} s(x) \cdot \cos(n \cdot x) dx = \frac{2}{\pi} \cdot \int_0^{\pi} s(x) \cdot \cos(n \cdot x) dx = \frac{2}{\pi} \cdot \int_0^{\pi} x \cdot \cos(n \cdot x) dx,$$

denn die Funktion $x \mapsto s(x) \cdot \cos(n \cdot x)$ ist einerseits periodisch mit der Periode $2 \cdot \pi$ und andererseits gerade. Im Falle $n = 0$ haben wir

$$a_0 = \frac{2}{\pi} \cdot \int_0^{\pi} x \cdot \cos(0 \cdot x) dx = \frac{2}{\pi} \cdot \int_0^{\pi} x dx = \frac{2}{\pi} \cdot \frac{x^2}{2} \Big|_0^{\pi} = \frac{2}{\pi} \cdot \frac{\pi^2}{2} = \pi.$$

Andernfalls berechnen wir das Integral mit Hilfe partieller Integration. Wir setzen $v'(x) = \cos(n \cdot x)$ und $u(x) = x$. Dann gilt $v(x) = \frac{1}{n} \cdot \sin(n \cdot x)$ und $u'(x) = 1$, also haben wir für $n \geq 1$

$$\begin{aligned} a_n &= \frac{2}{\pi} \cdot \left(x \cdot \frac{1}{n} \sin(n \cdot x) \Big|_0^{\pi} - \frac{1}{n} \cdot \int_0^{\pi} \sin(n \cdot x) dx \right) \\ &= \frac{2}{\pi} \cdot \left(0 - \frac{1}{n^2} \cdot \cos(n \cdot x) \Big|_0^{\pi} \right) \\ &= \frac{2}{\pi} \cdot \frac{1}{n^2} \cdot \left((-1)^n - 1 \right), \end{aligned}$$

denn $\cos(n \cdot \pi) = (-1)^n$. Damit haben wir insgesamt

$$a_0 = \pi, \quad a_{2 \cdot n+1} = \frac{-4}{\pi \cdot n^2} \quad \text{und} \quad a_{2 \cdot (n+1)} = 0 \quad \text{für } n \in \mathbb{N}.$$

(2) Die Koeffizienten b_n ergeben sich als

$$b_n = \frac{1}{\pi} \cdot \int_0^{2 \cdot \pi} s(x) \cdot \sin(n \cdot x) dx = 0$$

denn die Funktion $s(x) \cdot \sin(n \cdot x)$ ist sowohl periodisch mit der Periode $2 \cdot \pi$ als auch ungerade.

Insgesamt haben wir jetzt die Formel

$$s(x) = \frac{\pi}{2} - \frac{4}{\pi} \cdot \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{(2 \cdot k + 1)^2} \cdot \cos((2 \cdot k + 1) \cdot x)$$

gefunden. Setzen wir hier für x den Wert π ein, so ergibt sich wegen $\cos((2 \cdot k + 1) \cdot \pi) = -1$

$$\begin{aligned} \pi &= \frac{\pi}{2} - \frac{4}{\pi} \cdot \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{(2 \cdot k + 1)^2} \cdot \cos((2 \cdot k + 1) \cdot \pi) \\ \Leftrightarrow \frac{\pi}{2} &= \frac{4}{\pi} \cdot \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{(2 \cdot k + 1)^2} \\ \Leftrightarrow \frac{\pi^2}{8} &= \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{(2 \cdot k + 1)^2}. \end{aligned}$$

Damit sind wir jetzt in der Lage, die Reihe

$$\sigma := \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^2}$$

zu berechnen. Zunächst zerlegen wir die Reihe in einen Teil, der nur über die geraden Indices läuft und einen Teil, der über die ungeraden Indices läuft:

$$\begin{aligned} \sigma &= \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{(2 \cdot n)^2} + \sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{(2 \cdot n + 1)^2} \\ \Leftrightarrow \sigma &= \frac{1}{4} \cdot \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^2} + \frac{\pi^2}{8} \\ \Leftrightarrow \sigma &= \frac{1}{4} \cdot \sigma + \frac{\pi^2}{8} \\ \Leftrightarrow \frac{3}{4} \cdot \sigma &= \frac{\pi^2}{8} \\ \Leftrightarrow \sigma &= \frac{\pi^2}{6} \end{aligned}$$

Damit haben wir also die Formel

$$\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^2} = \frac{\pi^2}{6}$$

gezeigt. Die Frage nach dem Wert dieser Reihe war 1644 als *Basel'sches Problem* von Pietro Mengoli gestellt worden. Führende Mathematiker des 17-ten Jahrhunderts hatten sich erfolglos mit dieser Frage beschäftigt. Im Jahre 1735 gelang es Leonard Euler (1707 - 1783), dieses Problem zu lösen.

Aufgabe 47: Die Funktion p sei auf dem Intervall $[-\pi, \pi]$ definiert durch

$$p(x) = x^2.$$

Die Funktion werde so auf \mathbb{R} fortgesetzt, dass die resultierende Funktion die Periode $2 \cdot \pi$ hat.

- (1) Berechnen Sie die Fourier-Reihe von p .
- (2) Berechnen Sie mit Hilfe der Fourier-Reihe von p einen Wert für die Reihe

$$\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^2}.$$

Kapitel 8

Rundungsfehler

Die meisten komplexen Probleme lassen sich nur mit numerischen Verfahren lösen. Wir haben bereits verschiedene numerische Verfahren kennengelernt, beispielsweise Verfahren zur Berechnung von Nullstellen sowie Verfahren zur numerischen Integration. Allen diesen Verfahren ist gemeinsam, dass zwei verschiedene Arten von Fehlern auftreten:

- (1) Ein *Approximations-Fehler* tritt auf, wenn wir einen Wert λ berechnen wollen, zu dessen Berechnung wir nur eine Näherungsformel existiert. Oft ist der Approximations-Fehler ein *Abbruch-Fehler*, der seine Ursache darin hat, dass wir nur endlich viele Glieder einer unendlichen Reihe berechnen können. Wollen wir beispielsweise die Euler'sche Zahl e nach der Formel

$$e = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!}$$

berechnen, so können wir auf dem Rechner diese Summe nicht gegen unendlich laufen lassen, sondern müssen die Summe nach endlich vielen Gliedern abbrechen, wir berechnen also als Approximation für e eine Reihe der Form

$$e_n := \sum_{k=0}^n \frac{1}{k!}$$

und müssen dann n so groß wählen, dass der Abbruch-Fehler

$$e - e_n = \sum_{k=n+1}^{\infty} \frac{1}{k!}$$

unterhalb einer vorgegeben Schranke bleibt.

- (2) Zusätzlich zum Approximations-Fehler gibt es noch die Rundungsfehler, die im Laufe der Rechnung entstehen. Diese Rundungsfehler haben Ihre Ursache darin, dass Fließkomma-Zahlen auf dem Rechner mit einer vorgegebenen Genauigkeit dargestellt werden. Rechnen wir in der Sprache *Java* mit einer Fließkomma-Zahl vom Typ `float`, so stehen zur Darstellung der Stellen hinter dem Komma lediglich 23 Bits zur Verfügung. Werden nun zwei solche Zahlen multipliziert, so könnten bis zu 47 Bits notwendig sein, um alle Stellen hinter dem Komma korrekt wiedergeben zu können. Da aber zum Abspeichern des Ergebnisses lediglich 23 Bits zur Verfügung stehen, um die Ziffern hinter dem Komma abzuspeichern, bleibt nichts anderes übrig, als das Ergebnis auf 23 Bits zu runden. Der dadurch entstehende Fehler wird als Rundungsfehler bezeichnet.

Die Auswirkungen von Rundungsfehlern werden oft unterschätzt. Unter

<http://www.devtopics.com/20-famous-software-disasters-part-2/>

findet sich eine Liste der 20 spektakulärsten Software-Fehler, die Katastrophen ausgelöst haben. In mehreren Fällen waren Rundungsfehler ein Teil des Problems. Um einen ersten Eindruck von

der Wirkung von Rundungsfehlern zu bekommen, betrachten wir das in Abbildung 8.1 gezeigte Programm zur Berechnung der Reihe

$$\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n}.$$

```

1  harmonic := procedure() {
2      oldSum := 0.0;
3      sum := 1.0;
4      n := 1;
5      while (oldSum < sum) {
6          oldSum := sum;
7          n += 1;
8          sum += 1/n;
9      }
10     print("sum = $sum$, n = $n$");
11 };
12 harmonic();

```

Abbildung 8.1: Berechnung von $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n}$.

Sie erwarten jetzt vielleicht, dass dieses Programm nie terminiert, aber wenn wir dieses Programm in einer Datei mit dem Namen “`harmonic.stlx`” speichern und es dann mit dem Befehl

```
setlX --real32 harmonic.stlx
```

starten, dann erhalten wir nach wenigen Sekunden die Meldung:

```
sum = 13.05426, n = 200001.
```

Da wir früher bewiesen haben, dass die Partialsummen $\sum_{k=1}^n \frac{1}{k}$ für wachsende Werte von n beliebig groß werden, fragen wir uns, was bei der Rechnung schief gelaufen ist. Die Antwort ist, dass für $n = 200001$ der Wert $\frac{1}{n}$ so klein ist, dass die Summe

$$13.05426 + \frac{1}{n}$$

so nahe bei 13.05426 liegt, dass sie auf den Wert 13.05426 abgerundet wird. Um diesen Effekt näher zu beschreiben, definiert man für einen vorgegebenen Rechner die sogenannte *Maschinen-Konstante* ϵ als die kleinste positive Zahl, die, wenn sie auf diesem Rechner zu 1 addiert wird, ein Ergebnis größer als 1 ergibt. Die formale Definition lautet

$$\epsilon := \min(\{x \in \mathbb{R} \mid x > 0 \wedge 1 \oplus x > 1\}).$$

Hier bezeichnet \oplus die auf dem Rechner implementierte Addition. Abbildung 8.2 zeigt ein einfaches Programm zur Berechnung der Maschinen-Konstante. Bei der im IEEE-Standard 754 definierten 32-Bit-Architektur erhalten wir für ϵ den Wert

$$\epsilon_{32} = 9.536745 \cdot 10^{-7},$$

bei einer 64-Bit-Architektur lautet das Ergebnis

$$\epsilon_{64} = 8.88178419700125 \cdot 10^{-16},$$

und wenn wir mit 128-Bit rechnen, haben wir

$$\epsilon_{128} = 7.703719777548943412223911770339695 \cdot 10^{-34}.$$

Bei modernen Rechnern, die den IEEE-Standard 754 implementieren, können wir davon ausgehen, dass der relative Rundungsfehler bei der Ausführung einer Grundrechenoperation durch die

```
1  maschinenKonstante := procedure() {
2      eps := 1.0;
3      old := eps;
4      while (1.0 + eps > 1.0) {
5          old := eps;
6          eps /= 2;
7      }
8      return old;
9  };
```

Abbildung 8.2: Berechnung der Maschinen-Konstante *eps*.

Maschinen-Konstante *eps* beschränkt ist.

Leider muss die Vorlesung aus Zeitgründen an dieser Stelle enden. Der interessierten Leser sei daher auf die Literatur, insbesondere den Artikel von Goldberg [8] verwiesen.

Literaturverzeichnis

- [1] Forster, Otto: *Analysis I, Differential- und Integralrechnung einer Veränderlichen*. Vieweg+Teubner, 11te Auflage, 2011.
- [2] Grauert, Hans und Ingo Lieb: *Differential- und Integralrechnung I*. Springer, 1967.
- [3] Heuser, Harro: *Lehrbuch der Analysis, Teil 1*. Teubner, 15te Auflage, 2003.
- [4] Heuser, Harro: *Lehrbuch der Analysis, Teil 2*. Teubner, 14te Auflage, 2008.
- [5] Dedekind, Richard: *Essays on the Theory of Numbers*. The Open Court Publishing Company, 1901.
- [6] Dowell, M. und P. Jarrat: *A modified regula falsi method for computing the root of an equation*. BIT Numerical Mathematics, 11(2):168–174, 1971.
- [7] Rosenlicht, Maxwell: *Integration in finite terms*. The American Mathematical Monthly, 79(9):963–972, November 1972.
- [8] Goldberg, David: *What Every Computer Scientist Should Know About Floating-Point Arithmetic*. ACM Computing Surveys, 23(1):5–48, 1991. Available from <http://www.validlab.com/goldberg/paper.ps>.