

Appunti di fondamenti di analisi e probabilità

Giacomo Simonetto

Primo semestre 2024-25

Sommario

Appunti del corso di Fondamenti di analisi e probabilità della facoltà di Ingegneria Informatica dell'Università di Padova.

Indice

1	Curve e sostegni	3
1.1	Introduzione sugli intorni	3
1.2	Funzioni vettoriali e curve	4
1.3	Limiti di funzioni vettoriali	4
1.4	Derivate di funzioni vettoriali	4
1.5	Derivate direzionali e derivate parziali	5
1.6	Gradiente	5
1.7	Spazio tangente e differenziabilità	7
1.8	Derivate seconde, matrice Hessiana	7
1.9	Massimi e minimi	7

1 Curve e sostegni

1.1 Introduzione sugli intorni

Definizioni su palle e cubi

- Norma di un vettore: $|x| := \sqrt{x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_n^2}$
- Distanza tra due punti: $\text{dist}(x, y) := |x - y|$
- Disuguaglianza triangolare: $|x - y| \leq |x| + |y|$
- Disco o palla chiusa: $B(p, r] := \{x \in \mathbb{R}^n : |x - p| \leq r\}$
- Disco o palla aperta: $B(p, r[:= \{x \in \mathbb{R}^n : |x - p| < r\}$
- Bordo di una palla: $\partial B(p, r] = \partial B(p, r[:= \{x \in \mathbb{R}^n : |x - p| = r\}$
- Quadrato o cubo chiuso: $Q(p, r] := \{(x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n : |x_1 - p_1| \leq r, \dots, |x_n - p_n| \leq r\}$
- Quadrato o cubo aperto: $Q(p, r[:= \{(x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n : |x_1 - p_1| < r, \dots, |x_n - p_n| < r\}$
- Bordo di un quadrato: $\partial Q(p, r] = \partial Q(p, r[:= \{(x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n : |x_1 - p_1| = r, \dots, |x_n - p_n| = r\}$

Teorema di inclusione tra palle e cubi

Ogni palla contiene un cubo di stesso centro e viceversa.

Fissato $p \in \mathbb{R}^n$ e $r > 0$ vale $B(p, r] \subseteq Q(p, r]$ e $Q(p, r] \subseteq B(p, r\sqrt{n}]$

Definizione di intorno

Un intorno di $p \in \mathbb{R}^n$ è un insieme che contiene una palla centrata in p . Per il teorema precedente, la proposizione vale anche per i quadrati.

Definizione di punto interno ad un insieme

Il punto $p \in D$ è un punto interno all'insieme D se $\exists \delta > 0 : B(p, \delta[\subset D$.

L'insieme dei punti interni di un insieme D si indica con $\text{int}(D)$.

Insieme aperto, chiuso, frontiera e chiusura

- Un insieme è aperto se ogni suo punto è un punto interno: $D = \text{int}(D)$
- Un insieme è chiuso se il suo complementare è aperto
Osservazione: \emptyset e \mathbb{R}^n sono sia aperti che chiusi
- La frontiera ∂D è l'insieme dei punti tali che ogni loro intorno interseca sia D , sia $\mathbb{R}^n \setminus D$
- La chiusura \overline{D} è il più piccolo insieme chiuso contenente D : $\overline{D} = D \cup \partial D$

Prodotto scalare

Il prodotto scalare tra due vettori $x = (x_1, \dots, x_n)$ e $y = (y_1, \dots, y_n)$ di \mathbb{R}^n è il numero reale definito come $x \cdot y = x_1 y_1 + \dots + x_n y_n$.

Due vettori sono ortogonali se il loro prodotto scalare è 0.

Disuguaglianza di Cauchy-Schwarz

Siano $x, y \in \mathbb{R}^n$, allora $|x \cdot y| \leq |x| |y|$. Si ha l'uguaglianza se solo se uno è multiplo dell'altro.

1.2 Funzioni vettoriali e curve

Definizione di funzioni vettoriali, curve, sostegni di curve

- Una funzione vettoriale è una funzione $f : I_{intervallo} \subset \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^n$, $t \mapsto f(t) = (f_1(t), f_2(t), \dots, f_n(t))$
- Una curva (parametrica) è una funzione vettoriale in cui $f_1(t), \dots, f_n(t)$ sono continue in $I = [a, b]$
- Il sostegno di una curva f è l'insieme immagine di f : $f([a, b]) := \{f(t) : t \in [a, b]\} \subset \mathbb{R}^n$
- Una curva si dice cartesiana se è della forma $f(t) = (t, h(t))$ o $f(t) = (h(t), t)$, $t \in [a, b]$
- Una curva si dice chiusa se $f(a) = f(b)$
- Una curva si dice semplice se $f(t_1) \neq f(t_2)$, $\forall t_1, t_2$ con $a < t_1 < t_2 \leq b$, ovvero se non si interseca mai ad eccezione degli estremi

Curve e sostegni

- Data una curva $f(t)$, per ottenere il sostegno di tale curva, bisogna eliminare il parametro t , passando dalla forma parametrica a quella cartesiana.
- Viceversa se, dato un sostegno, si vuole ottenere una curva, bisogna introdurre una parametrizzazione del sostegno, passando dalla forma cartesiana a quella parametrica.

1.3 Limiti di funzioni vettoriali

Definizione di limite (finito) in una e più dimensioni

$$\begin{aligned}\lim_{t \rightarrow t_0} f(t) = \ell \in \mathbb{R}^n &\Rightarrow \forall V \text{ intorno di } \ell \exists U \text{ intorno di } p \text{ t.c. } x \in U \setminus \{p\} \Rightarrow f(x) \in V \\ &\Rightarrow \forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \text{ t.c. } 0 < |t - t_0| < \delta \Rightarrow |f(t) - \ell| < \varepsilon \\ \lim_{t \rightarrow t_0} (f_1(t), f_2(t), \dots, f_n(t)) = (\ell_1, \ell_2, \dots, \ell_n) &\Leftrightarrow \lim_{t \rightarrow t_0} f_1(t) = \ell_1, \lim_{t \rightarrow t_0} f_2(t) = \ell_2, \dots, \lim_{t \rightarrow t_0} f_n(t) = \ell_n\end{aligned}$$

Continuità

Una funzione è continua se $\lim_{t \rightarrow t_0} f(t) = f(t_0)$. Nel caso di funzioni vettoriali, essa è continua se ogni sua componente è continua.

1.4 Derivate di funzioni vettoriali

Definizione di derivata in una e più dimensioni

Una funzione f è derivabile in t_0 se esiste il limite finito del rapporto incrementale.

$$\begin{aligned}f'(t_0) &:= \lim_{t \rightarrow t_0} \frac{f(t) - f(t_0)}{t - t_0} = \ell \in \mathbb{R}^n \\ f(t) = (f_1(t), f_2(t), \dots, f_n(t)) &\Leftrightarrow f'(t_0) = (f'_1(t_0), f'_2(t_0), \dots, f'_n(t_0))\end{aligned}$$

Retta tangente ad una curva

Se f è derivabile in t_0 e $f'(t_0) \neq 0$:

- il vettore tangente alla curva è $f'(t_0)$
- la retta tangente alla curva è $\{f(t_0) + f'(t_0)\lambda, \lambda \in \mathbb{R}\}$

Si parla di tangenza alla curva e non al sostegno perché una funzione può passare per lo stesso punto in due momenti diversi. In questo caso si avrebbero due tangenti diverse per uno stesso punto del sostegno, quando invece sarebbero due tangenti associate a due valori diversi del parametro della curva.

Funzioni o curve differenziabili e approssimazioni di primo ordine

Una funzione $f(t)$ si dice differenziabile se vale (specialmente il limite):

$$f(t) = f(t_0) + f'(t_0)(t - t_0) + R(t) \quad \lim_{t \rightarrow t_0} \frac{R(t)}{t - t_0} = 0$$

Regole di derivazione di curve

Siano $f, g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^n$ curve derivabili, $\varphi, u : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ funzioni derivabili, $\alpha \in \mathbb{R}$, allora:

1. $\frac{d}{dt} (\text{costante}) = 0$
2. $\frac{d}{dt} (\alpha f) = \alpha f'$
3. $\frac{d}{dt} (\varphi(t)f(t)) = \varphi'(t)f(t) + \varphi(t)f'(t)$
4. $\frac{d}{dt} (f + g) = f' + g'$
5. $\frac{d}{dt} (f \cdot g) = f' \cdot g + f \cdot g'$
6. $\frac{d}{dt} (f \circ u) = f'(u)u'$

1.5 Derivate direzionali e derivate parziali

Definizione di derivata direzionale

La derivata direzionale di f in un punto p lungo la direzione \vec{u} è definita come il limite, se esiste finito del rapporto incrementale.

$$\begin{aligned} D_{\vec{u}}f(p) = \partial_{\vec{u}}f(p) &:= \lim_{t \rightarrow 0} \frac{f(p + t\vec{u}) - f(p)}{t} = \ell \in \mathbb{R} \\ &:= g'(0) \text{ con } g(t) = f(p + t\vec{u}) \end{aligned}$$

Per trovare la derivata direzionale bisogna fare:

1. trovare la funzione $g(t) = f(p + t\vec{u})$
2. calcolare la derivata $g'(t)$
3. valutare la derivata per $t \rightarrow 0$

Oss nel caso in cui la funzione f non sia continua in p e non è possibile definire esattamente $g(t)$ e $g'(t)$, è consigliato usare la definizione per calcolare $g'(0) = \lim_{t \rightarrow 0} \frac{g(t) - g(0)}{t} = \lim_{t \rightarrow 0} \frac{f(p + t\vec{u}) - f(p)}{t}$

Definizione di derivata parziale

La i -esima derivata parziale di f in p è la derivata direzionale lungo \vec{e}_i di $f(x_1, \dots, x_n)$,

$$\begin{aligned} \partial_{x_i}f(p) = D_{\vec{e}_i}f(p) &= \frac{d}{dx_i}f(p) \quad \text{casi particolari:} \\ \partial_x f(p) &= D_{(1,0)}f(p) = \frac{d}{dx}f(p) \\ \partial_y f(p) &= D_{(0,1)}f(p) = \frac{d}{dy}f(p) \end{aligned}$$

Continuità e derivate direzionali

- Una funzione può non essere continua in un punto p , ma avere lo stesso derivate parziali e direzionali. In questo caso si sfrutta la definizione di derivata per calcolarne il valore.

Proprietà delle derivate direzionali

1. $D_u(f(p) + g(p)) = D_u f(p) + D_u g(p)$
2. $D_u(f(p)g(p)) = D_u f(p) g(p) + f(p)D_u g(p)$
3. $D_u(cf(p)) = cD_u f(p)$
4. $D_u(\varphi \circ p)(p) = D_u \varphi(f(p)) = \varphi'(f(p))D_u f(p)$

1.6 Gradiente

Definizione di gradiente

$$\vec{\nabla}f(p) := (\partial_{x_1}f(p), \partial_{x_2}f(p), \dots, \partial_{x_n}f(p))$$

Proprietà del gradiente

1. $\vec{\nabla}(f(p) + g(p)) = \vec{\nabla}f(p) + \vec{\nabla}g(p)$
2. $\vec{\nabla}(f(p)g(p)) = \vec{\nabla}f(p) g(p) + f(p)\vec{\nabla}g(p)$
3. $\vec{\nabla}(cf(p)) = c\vec{\nabla}f(p)$
4. $\vec{\nabla}(\varphi \circ f)(p) = \vec{\nabla}(\varphi(f(p))) = \varphi'(f(p))\vec{\nabla}f(p)$
5. gradiente della norma: $\vec{\nabla}|x| = \frac{x}{|x|}$

Relazione tra gradiente e derivate direzionali in funzioni C^1

Una funzione f è di classe C^1 in un aperto se:

- f è continua
- f ha derivate parziali continue

In una funzione C^1 , le derivate direzionali e il gradiente hanno la seguente relazione:

$$\forall u \in \mathbb{R}^n \quad D_u f(p) = \vec{\nabla}f(p) \cdot \vec{u} = \partial_{x_1} f(p)u_1 + \partial_{x_2} f(p)u_2 + \dots \partial_{x_n} f(p)u_n$$

Osservazione: se in una funzione generica la derivata parziale $D_{(u_1, u_2)} f(p)$ non è esprimibile come combinazione lineare delle derivate parziali, allora non è C^1 . In altre parole se non vale l'equazione $D_u f(p) = \vec{\nabla}f(p) \cdot \vec{u}$, allora $f \notin C^1$.

Direzione di massima e minima crescita

Se f è C^1 in un intorno di p , la direzione lungo cui si ha la massima pendenza è la direzione del vettore gradiente. Viceversa la direzione di minore crescita è opposta a quella di massima crescita.

$$\begin{aligned} D_{u_{max}} f(p) &= \left| \vec{\nabla}f(p) \right| & \Leftrightarrow & \quad u_{max} = \frac{\vec{\nabla}f(p)}{\left| \vec{\nabla}f(p) \right|} \\ D_{u_{min}} f(p) &= - \left| \vec{\nabla}f(p) \right| & \Leftrightarrow & \quad u_{min} = - \frac{\vec{\nabla}f(p)}{\left| \vec{\nabla}f(p) \right|} \end{aligned}$$

1.7 Spazio tangente e differenziabilità

Spazio tangente

Differenziabilità

Continuità di funzioni differenziabili

Gradiente di funzioni differenziabili

Regola della catena di derivate parziali

Gradiente e curve di livello

1.8 Derivate seconde, matrice Hessiana

Derivate seconde

Matrice Hessiana

Teorema di Schwarz

1.9 Massimi e minimi

Definizione di massimi, minimi e punti di sella

Regola di Fermat

Ricerca dei punti critici

Criterio dell'Hessiana