

ШАД. Хэндбук поступающего

Автор: Даниил Скороходов

@neuralspeedster

24.01.2026

Содержание

A. Алгебра	12
A.1. Перестановки	12
A.1.1. Умножение перестановок	12
A.1.1.1. Свойства произведения перестановок	13
A.1.2. Количество перестановок	13
A.1.3. Циклы	13
A.1.4. Степень перестановки	13
A.1.5. Орбита элемента	14
A.1.5.1. Свойства орбит элементов	14
A.1.6. Теорема о разложении перестановки в произведение независимых циклов	15
A.1.7. Транспозиции	16
A.1.8. Инверсии и знак перестановки	17
A.2. Комплексные числа	20
A.2.1. Алгебраическая форма записи	20
A.2.2. Единственность поля комплексных чисел	20
A.2.3. Существование поля комплексных чисел	21
A.2.4. Геометрическая интерпретация комплексных чисел	22
A.2.5. Тригонометрическая форма записи	23
A.2.6. Формы записи комплексных чисел	24
A.2.7. Умножение комплексных чисел в тригонометрической форме	25
A.2.8. Извлечение корней	26
A.2.9. Корни из единицы	27
A.3. Системы линейных алгебраических уравнений	30
A.3.1. Сложение и умножение строк	30
A.3.2. Элементарные преобразования систем линейных уравнений и их матриц	31
A.3.3. Метод Гаусса решения систем линейных уравнений	32
A.3.4. Ранг ступенчатой матрицы	33
A.3.5. Критерий совместности и определённости системы	34
A.3.6. Однородные системы линейных уравнений	34
A.4. Векторные пространства	35
A.4.1. Примеры векторных пространств	35
A.4.2. Простейшие следствия из аксиом векторного пространства	36

A.4.3.	Линейные комбинации	36
A.4.3.1.	Примеры линейных комбинаций	37
A.4.4.	Свойства линейной зависимости	37
A.4.5.	Базис системы векторов	40
A.4.5.1.	Примеры базисов	40
A.4.6.	Единственность выражения через базисные векторы	41
A.4.7.	Базис системы векторов из \mathbb{R}^n	42
A.4.8.	Переход к новому базису	42
A.4.9.	Подпространство векторного пространства	43
A.4.9.1.	Свойства подпространства	43
A.4.10.	Фундаментальная система решений	44
A.4.11.	Пересечение и сумма подпространств	45
A.5.	Ранг системы векторов и ранг матрицы	47
A.5.1.	Ранг системы векторов	47
A.5.1.1.	Свойства ранга системы векторов	47
A.5.2.	Ранг матрицы	47
A.5.2.1.	Определение горизонтального, вертикального и ступенчатого ранга	47
A.5.2.2.	Теорема о ранге матрицы	48
A.5.3.	Свойства ранга матрицы	50
A.6.	Линейные отображения	51
A.6.1.	Матрица линейного отображения	51
A.6.2.	Алгебраические операции над линейными отображениями	51
A.6.3.	Алгебраические операции над матрицами	51
A.6.4.	Матричная запись линейного отображения	53
A.6.5.	Свойства матричных операций	53
A.6.6.	Взаимодействие транспонирования и алгебраических операций над матрицами	55
A.6.7.	Ранг произведения двух матриц	55
A.6.8.	Тождественное отображение	56
A.6.8.1.	Основное свойство тождественного отображения и единичной матрицы	56
A.6.9.	Обратная матрица	56
A.6.10.	Алгоритм нахождения обратной матрицы	58
A.6.11.	Элементарные матрицы	59

A.6.11.1.	Основное свойство элементарных матриц	59
A.6.11.2.	Разложение невырожденной матрицы в произведение элементарных матриц	61
A.7.	Определители	62
A.7.1.	Свойства определителя	62
A.7.2.	Вычисление определителя через приведение матрицы к треугольному виду	65
A.7.3.	Определитель треугольной матрицы	65
A.7.4.	Определитель и другие кососимметричные полилинейные функции строк	66
A.7.5.	Разбиение матрицы на 4 блока	66
A.7.6.	Определитель Вандермонда	67
A.7.6.1.	Вычисление определителя Вандермонда	68
A.7.6.2.	Основное свойство определителя Вандермонда	68
A.7.7.	Критерий невырожденности матрицы	69
A.7.8.	Мультиплекативное свойство определителя	69
A.7.9.	Миноры и вычисление определителей	69
A.7.10.	Лемма о фальшивом разложении определителя	71
A.7.11.	Формула обратной матрицы	72
A.7.12.	Метод Крамера решения СЛУ	73
A.7.13.	Теорема о ранге матрицы	74
A.8.	Группы, кольца, поля	76
A.8.1.	Следствия из аксиом группы	76
A.8.1.1.	Абелевы группы	76
A.8.2.	Примеры групп и не групп	76
A.8.3.	Подгруппа	77
A.8.4.	Кольца	77
A.8.4.1.	Классы колец	78
A.8.4.2.	Примеры колец	78
A.8.5.	Следствия из аксиом кольца	78
A.8.6.	Обратный элемент в кольце	79
A.8.7.	Делители нуля	80
A.8.8.	Поля	80
A.8.9.	Кольца вычетов	81
A.8.10.	Характеристика поля	83

A.8.11. Малая теорема Ферма	84
A.8.12. Китайская теорема об остатках	84
A.9. Кольцо многочленов	86
A.9.1. Единственность кольца многочленов	87
A.9.2. Существование кольца многочленов	87
A.9.3. Алгебраические свойства многочленов	89
A.9.4. Кольцо многочленов над полем	90
A.9.4.1. Задача полиномиальной интерполяции	90
A.9.4.2. Теорема об интерполяции	90
A.9.5. Деление многочленов с остатком	92
A.9.6. Теорема Безу	93
A.9.7. Теорема о количестве корней ненулевого многочлена	94
A.9.8. Производная многочлена	94
A.9.9. Высшая производная многочлена	96
A.9.10. Разложение многочлена на линейные множители над полем	97
A.10. Теория делимости в кольцах многочленов	99
A.10.1. Свойства ассоциированности	99
A.10.2. Наибольший общий делитель	100
A.10.3. Евклидовы кольца	100
A.10.4. Простые элементы и основная теорема арифметики в евклидовом кольце	101
A.10.5. Факториальные кольца	103
A.11. Линейные операторы	105
A.11.1. Собственные значения и собственные векторы	105
A.11.2. Функции от линейного оператора	106
A.11.3. Задачи	107
A.12. Билинейные функции и квадратичные формы	108
A.12.1. Квадратичные формы	108
A.12.2. Ортогонализация Грама-Шмидта	110
A.12.3. Примеры	112
A.12.4. Применение квадратичных форм: классификация конических сечений	113
A.13. Евклидовы пространства	114
B. Математический анализ	116
B.1. Числовые последовательности	116

B.1.1.	Предел последовательности	116
B.1.2.	Ограниченнность	117
B.1.3.	Единственность предела	117
B.1.4.	Свойства пределов, связанные с неравенствами	118
B.1.5.	Бесконечно малые последовательности	119
B.1.6.	Арифметические свойства пределов	120
B.1.7.	Монотонные последовательности	122
	B.1.7.1. Теорема Вейерштрасса	122
B.1.8.	Кто растёт быстрее?	123
B.1.9.	Число e	125
	B.1.9.1. Первое доказательство существования e	125
	B.1.9.2. Второе доказательство существования e	126
B.1.10.	Подпоследовательность	127
	B.1.10.1. Теорема Больцано-Вейерштрасса	128
B.1.11.	Критерий Коши сходимости числовых последовательностей	129
B.2.	Предел функции	131
B.2.1.	Определение предела по Коши	131
B.2.2.	Определение предела по Гейне	131
B.2.3.	Эквивалентность определений Коши и Гейне	131
B.2.4.	Теорема о промежуточной функции	132
B.2.5.	Арифметические свойства пределов функции	133
B.2.6.	Критерий Коши существования предела функции	134
B.3.	Интегрирование	136
B.3.1.	Разложение на простейшие дроби	136
B.3.2.	Интегрирование биномиальных дифференциалов	137
B.3.3.	Интегрирование тригонометрических функций	138
B.3.4.	Использование вычетов	138
B.4.	Кратные интегралы	142
B.4.1.	Двойные интегралы	142
	B.4.1.1. Определение двойного интеграла	142
	B.4.1.2. Суммы Дарбу	143
	B.4.1.3. Свойства двойного интеграла	143
	B.4.1.4. Сведение двойного интеграла к повторному	145
B.4.2.	Тройные интегралы	145
	B.4.2.1. Определение тройного интеграла	145

B.5.	Гамма-функция и бета-функция	146
B.5.1.	Гамма-функция	146
B.5.1.1.	Свойства гамма-функции	146
B.5.2.	Бета-функция	149
B.5.2.1.	Свойства бета-функции	149
B.5.3.	Связь гамма-функции и бета-функции	150
B.6.	Числовые ряды	152
B.6.1.	Необходимый признак сходимости ряда	153
B.6.2.	Признаки сходимости положительных рядов	153
B.6.2.1.	Теоремы сравнения	153
B.6.2.2.	Радикальный признак Коши	155
B.6.2.3.	Признак Даламбера	156
B.6.2.4.	Признак Раабе	157
B.6.2.5.	Интегральный признак Маклорена-Коши	158
B.6.3.	Сходимость произвольных рядов	160
B.6.3.1.	Абсолютная сходимость	160
B.6.3.2.	Знакопеременные ряды и признак Лейбница	161
B.7.	Начало комплексного анализа	162
B.7.1.	Предел комплексной последовательности	162
B.7.2.	Сфера Римана	163
B.7.3.	Ряды комплексных чисел	163
B.8.	Комплексные функции	164
B.8.1.	Предел и непрерывность функции комплексного переменного ...	164
B.8.2.	Производная функции комплексного переменного	165
B.8.3.	Условия дифференцируемости	165
B.8.4.	Комплексная экспонента	167
B.8.5.	Тригонометрические и гиперболические функции комплексного переменного	167
B.9.	Комплексный интеграл	169
B.9.1.	Свойства комплексного интеграла	169
B.9.2.	Теорема о почленном интегрировании	170
B.9.3.	Интегральная теорема Коши	171
B.9.4.	Обобщённая теорема Коши и интегральная формула Коши	172
B.10.	Ряд Тейлора и ряд Лорана	174
B.10.1.	Ряд Тейлора	174

B.10.2.	Теорема Лиувилля и основная теорема алгебры \star	175
B.10.3.	Ряд Лорана	176
B.10.4.	Неравенство Коши для коэффициентов ряда Лорана	179
B.11.	Изолированные особые точки и вычеты	180
B.11.1.	Классификация ИОТ	180
B.11.2.	Критерий полюса	183
B.11.3.	Полюс частного функций	183
B.11.4.	Теория вычетов	184
B.11.5.	Теорема Коши о вычетах	186
C.	Комбинаторика	188
C.1.	Основные правила комбинаторики	188
C.1.1.	Правила суммы и произведения	188
C.1.2.	Принцип Дирихле	188
C.1.3.	Примеры	189
C.2.	Множества	190
C.2.1.	Операции на множествах	190
C.2.2.	Свойства бинарных операций над множествами	190
C.2.3.	Кортеж	190
C.2.4.	Декартово произведение	191
C.2.5.	Возведение множества в степень множества	191
C.2.6.	Частичный порядок	191
C.3.	Перестановки, сочетания и размещения	193
C.3.1.	Тождества с биномиальными коэффициентами	194
C.3.2.	Перестановки с повторениями	195
C.3.3.	Полиномиальная формула	196
C.3.4.	Ещё одно тождество с биномиальными коэффициентами	196
C.4.	Формула включений-исключений	198
C.4.1.	Применение ФВИ	199
C.4.2.	Вероятность беспорядка	199
C.5.	Функция Мёбиуса	200
C.5.1.	Формула обращения Мёбиуса	200
C.5.2.	Решение комбинаторной задачи	201
C.5.3.	Функция Мёбиуса на ЧУМе	202
C.5.4.	Обращение Мёбиуса на ЧУМе	203

C.5.5.	Пример применения обращения Мёбиуса на ЧУМе для доказательства ФВИ	204
C.6.	Разбиение чисел в суммы	207
C.6.1.	Диаграмма Юнга	207
C.6.2.	Теорема Эйлера о разбиениях	207
C.7.	Линейные рекуррентные соотношения	209
C.7.1.	Случай второго порядка	209
C.7.2.	Общий случай	210
C.8.	Формальные степенные ряды и производящие функции	211
C.8.1.	Примеры	211
C.8.2.	Производящие функции	211
C.8.3.	Числа Каталана	213
C.9.	Основы теории графов	215
C.9.1.	Деревья	215
C.9.2.	Унициклические графы	217
D.	Теория вероятностей	218
D.1.	Основные понятия	218
D.1.1.	Следствия аксиом вероятности	218
D.1.2.	Полная группа попарно несовместных событий	219
D.1.3.	Классическое определение и прямой способ подсчёта	219
D.1.4.	Геометрическая вероятность	220
D.1.5.	Зависимые и независимые события. Теоремы + и ·	220
D.2.	Условная вероятность, независимость и схема испытаний Бернулли	222
D.2.1.	Формула полной вероятности	222
D.2.2.	Формула Байеса	222
D.2.3.	Схема испытаний Бернулли	222
D.2.4.	Асимптотические оценки вероятностей в схеме Бернулли	223
D.3.	Случайные величины	226
D.3.1.	Свойства функции распределения случайной величины	226
D.3.2.	Законы распределения дискретных случайных величин	226
D.3.3.	Распределение Бернулли. Индикатор. Биномиальное распределение	228
D.3.4.	Неограниченное число испытаний в схеме Бернулли. Распределение Пуассона	229

D.3.5.	Закон распределения абсолютно непрерывных случайных величин	229
D.4.	Числовые характеристики случайных величин	231
D.4.1.	Моменты, математическое ожидание и дисперсия дискретных случайных величин	231
D.4.2.	Производящие функции дискретных случайных величин	232
D.4.3.	Числовые характеристики абсолютно непрерывных случайных величин	233
D.5.	Основные распределения	235
D.5.1.	Равномерное распределение	235
D.5.2.	Показательное распределение	235
D.5.3.	Простейший поток событий	236
D.5.4.	Нормальное распределение	236
D.5.5.	Центрированная, нормированная случайная величина. Распределение линейной функции случайного аргумента	238
D.6.	Системы случайных величин	239
D.6.1.	Функция распределения двух переменных	239
D.6.2.	Система дискретных случайных величин и её числовые характеристики	239
D.6.3.	Система непрерывных случайных величин и её числовые характеристики	241
D.6.4.	Многомерное нормальное распределение	243
D.6.5.	Условия независимости случайных величин	243
D.6.6.	Свойства математического ожидания и дисперсии в системах СВ	243
D.6.7.	Свойства ковариации и корреляции	244
D.7.	Закон больших чисел и центральная предельная теорема	245
D.7.1.	Неравенства Маркова и Чебышёва	245
D.7.2.	Закон больших чисел	246
D.7.3.	Центральная предельная теорема	246
E.	Алгоритмы и структуры данных && программирование	247
E.1.	Основные понятия	247
E.1.1.	Анализ сложности и эффективности алгоритмов	247
E.2.	Асимптотические оценки функций	248
E.2.1.	Свойства сравнений функций	248

E.3.	Бинарный поиск	250
E.3.1.	Вариант с поиском границ	250
E.4.	Динамическое программирование	251
E.4.1.	Простые примеры ДП	251
E.4.1.1.	Ступеньки	251
E.4.1.2.	Ступеньки с сертификатом	251
E.4.1.3.	Наибольшая возрастающая подпоследовательность	252
E.4.1.4.	Покупка билетов	253
E.4.1.5.	Представление числа минимальной последовательностью операций	253
E.4.2.	Двумерное динамическое программирование	253
E.4.2.1.	Наибольшая общая подпоследовательность	253
E.4.2.2.	Расстояние Левенштейна	254
F.	Анализ данных	255

А. Алгебра

А.1. Перестановки

Определение. Пусть Ω - конечное множество из n элементов. Удобно считать, что $\Omega = \{1, 2, \dots, n\}$. Зададим множество всех биективных преобразований $\Omega \rightarrow \Omega$:

$$S = S_n(\Omega) = \{\sigma : \Omega \rightarrow \Omega \mid \sigma \text{ - биективно}\} \quad (1.1)$$

Элементы множества S называются *перестановками*(или *подстановками*) множества Ω .

Развёрнутая запись перестановки $\pi : i \rightarrow \pi(i) \forall i = 1, 2, \dots, n$ имеет вид:

$$\begin{pmatrix} 1 & 2 & \dots & n \\ \pi(1) & \pi(2) & \dots & \pi(n) \end{pmatrix} \quad (1.2)$$

Её также называют стандартной двухрядной.

Определение. Перестановка

$$e = \begin{pmatrix} 1 & 2 & \dots & n \\ 1 & 2 & \dots & n \end{pmatrix} \quad (1.3)$$

называется *единичной перестановкой*.

А.1.1. Умножение перестановок

Пусть $\pi, \sigma \in S$. Тогда их произведение $\pi\sigma$ находится из общего определения композиции преобразований. $\forall i = 1, \dots, n$:

$$(\pi\sigma)(i) = \pi(\sigma(i)) \quad (1.4)$$

Пусть, например, $\pi = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & 4 \\ 2 & 3 & 4 & 1 \end{pmatrix}$ и $\sigma = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & 4 \\ 4 & 3 & 2 & 1 \end{pmatrix}$. Тогда:

$$(\pi\sigma)(1) = \pi(\sigma(1)) = \pi(4) = 1 \quad (1.5)$$

$$(\pi\sigma)(2) = \pi(\sigma(2)) = \pi(3) = 4 \quad (1.6)$$

$$(\pi\sigma)(3) = \pi(\sigma(3)) = \pi(2) = 3 \quad (1.7)$$

$$(\pi\sigma)(4) = \pi(\sigma(4)) = \pi(1) = 2 \quad (1.8)$$

Таким образом, $\pi\sigma = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & 4 \\ 1 & 4 & 3 & 2 \end{pmatrix}$. Имеем:

$$\begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & 4 \\ 4 & 3 & 2 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & 4 \\ 2 & 3 & 4 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 & 4 \\ 3 & 2 & 1 & 4 \end{pmatrix} \quad (1.9)$$

A.1.1.1. Свойства произведения перестановок

Свойства произведения перестановок.

1. Ассоциативность: $\forall \alpha, \beta, \gamma \in S_n : \alpha(\beta\gamma) = (\alpha\beta)\gamma$.
2. Единичный элемент: $\exists e \in S_n : \forall \alpha \in S_n \alpha e = e\alpha$.
3. Обратная перестановка: $\forall \alpha \in S_n \exists \alpha^{-1} \in S_n : \alpha\alpha^{-1} = \alpha^{-1}\alpha = e$.

Действительно, можно для α поменять местами строки:

$$\alpha = \begin{pmatrix} i_1 & i_2 & \dots & i_n \\ j_1 & j_2 & \dots & j_n \end{pmatrix} \quad (1.10)$$

$$\alpha^{-1} = \begin{pmatrix} j_1 & j_2 & \dots & j_n \\ i_1 & i_2 & \dots & i_n \end{pmatrix}. \quad (1.11)$$

4. Некоммутативность. Вообще говоря, для $\alpha, \beta \in S_n$: $\alpha\beta \neq \beta\alpha$.

A.1.2. Количество перестановок

Мощность множества перестановок равна факториалу количества элементов Ω . Действительно, для каждого из n элементов множества Ω можно выбрать одно из n мест, затем для оставшихся $n - 1$ элементов — одно из $n - 1$ мест и так далее(согласно правилу произведения). В итоге получаем:

$$|S_n| = n(n - 1)(n - 2)\dots1 = n! \quad (1.12)$$

A.1.3. Циклы

Определение. Циклом длины $l \leq n$ называется такая перестановка $\sigma \in S_n$, что $\sigma(i_j) = (i_{j+1}) \forall j = 1, 2, \dots, (l - 1)$ и $\sigma(l) = i_1$, а все элементы, не указанные перечислением, остаются на своих местах.

Однорядная запись цикла:

$$(i_1, i_2, \dots, i_l) \quad (1.13)$$

Определение. Орбитой цикла называется множество элементов, которые участвуют в цикле: $\{i_1, i_2, \dots, i_l\}$.

Определение. Два цикла $\sigma = (i_1, i_2, \dots, i_l)$ и $\tau = (j_1, j_2, \dots, j_m)$ называются независимыми, если $\{i_1, i_2, \dots, i_l\} \cap \{j_1, j_2, \dots, j_m\} = \emptyset$.

Независимые циклы коммутативны: $\sigma\pi = \pi\sigma$.

A.1.4. Степень перестановки

Пусть $\pi \in S_n$. Тогда перестановка, равная π в степени $s \in \mathbb{Z}$ определяется так:

$$\pi^s = \begin{cases} \pi(\pi^{s-1}), & \text{если } s > 0 \\ e, & \text{если } s = 0 \\ (\pi^{-1})^{-s}, & \text{если } s < 0 \end{cases} \quad (1.14)$$

Свойства возвведения в степень перестановок:

1. $\forall \sigma \in S_n, \forall k, l \in \mathbb{Z} : \sigma^k \sigma^l = \sigma^{k+l}$
2. $(\sigma^k)^l = \sigma^{k \cdot l}$

A.1.5. Орбита элемента

Определение. Орбитой числа $i \in \{1, \dots, n\}$ под действием σ называется множество

$$O(i) \underset{\text{def}}{=} \{\sigma^k \mid k \in \mathbb{Z}\} \quad (1.15)$$

Среди элементов орбиты числа обязаны быть повторения:

$$\exists k, l \in \mathbb{Z}, k > l : \sigma^k(i) = \sigma^l(i) \quad (1.16)$$

Применим σ^{-l} :

$$\sigma^{k-l}(i) = \sigma^0(i) = i \quad (1.17)$$

Итак, существует положительная степень $k - l > 0$, такая, что перестановка σ в степени $k - l$ возвращает элемент на место. Тогда среди показателей положительных степеней можно выбрать наименьший.

$$m = \min_{p \in \mathbb{N}} \{p \mid \sigma^p(i) = i\} \quad (1.18)$$

Тогда для всех степеней, меньших m , орбита зацикливается и состоит всего из m чисел:

$$O(i) = \{i, \sigma(i), \sigma^2(i), \dots, \sigma^{m-1}(i)\}. \quad (1.19)$$

A.1.5.1. Свойства орбит элементов

1. Разные орбиты не пересекаются: $O(i) \cap O(j) = \emptyset$, если $i \neq j$.

Доказательство: \square Пусть $O(i) \cap O(j) \neq \emptyset$, тогда в пересечении этих орбит есть некоторое число k : $k \in O(i) \cap O(j)$, получим:

$$k = \sigma^p(i) = \sigma^q(j) \quad (1.20)$$

Если к левой и правой части равенства применить σ^{-p} , то получим:

$$i = \sigma^{q-p}(j) \quad (1.21)$$

Теперь мы можем получить, что любой элемент орбиты i лежит в $O(j)$, а именно $\forall l \in \mathbb{Z}$:

$$\sigma^l(i) = \sigma^{l+q-p}(j) \in O(j) \quad (1.22)$$

Итак,

$$O(i) \subseteq O(j) \quad (1.23)$$

Аналогично, меняя i и j , местами, получаем:

$$O(j) \subseteq O(i) \quad (1.24)$$

Но это в точности означает, что $O(i) = O(j)$. Значит, если две орбиты пересекаются, то они совпадают. ■

- Орбиты образуют разбиение множества чисел $\{1, \dots, n\}$ на попарно непересекающиеся подмножества.

Доказательство: □ Действительно, каждое число лежит в какой-то орбите, например, в своей. ■

A.1.6. Теорема о разложении перестановки в произведение независимых циклов

Теорема. Любая перестановка $\sigma \in S_n$ может быть представлена в виде произведения попарно независимых циклов:

$$\sigma = \sigma_1 \cdot \sigma_2 \cdot \dots \cdot \sigma_s, \quad (1.25)$$

Причём это разложение единственно с точностью до порядка множителей.

Доказательство: □ Запишем разбиение множества $\Omega = \{1, \dots, n\}$ на непересекающиеся орбиты:

$$\Omega = \underbrace{O_1 \cup O_2 \cup \dots \cup O_s}_{\begin{array}{c} \text{орбиты, в которых} \\ > 1 \text{ элемента} \end{array}} \cup \underbrace{O_{s+1} \cup \dots \cup O_t}_{\begin{array}{c} \text{единичные орбиты} \\ (\text{если есть}) \end{array}}, \quad (1.26)$$

При действии перестановки $\sigma \in S_n$ элементы обязательно перемещаются внутри своих орбит.

Каждой орбите соответствует цикл, причём эти циклы независимы в силу того, что орбиты непересекающиеся. Тогда перестановка σ записывается в виде произведения:

$$\sigma = (i_1, i_2, \dots, i_l) \cdot (j_1, j_2, \dots, j_m) \cdot \dots \cdot (k_1, k_2, \dots, k_p) \quad (1.27)$$

Мы доказали существование разложения на независимые циклы. Докажем единственность. Пусть перестановка σ разложена в произведение попарно независимых циклов:

$$\sigma = \sigma_1 \cdot \sigma_2 \cdot \dots \cdot \sigma_s, \quad (1.28)$$

где $\sigma_1 = (i_1, i_2, \dots, i_l), \sigma_2 = (j_1, j_2, \dots, j_m), \dots, \sigma_s = (k_1, k_2, \dots, k_p)$. Из схемы действия σ видно, что орбиты перестановки σ на Ω это орбиты $\sigma_1, \sigma_2, \dots, \sigma_s$ и оставшиеся неподвижные точки.

Таким образом, по σ можно однозначно восстановить орбиты циклов $\sigma_1, \sigma_2, \dots, \sigma_s$. А из них можно восстановить и сами циклы σ_i , потому что на своей орбите σ_i действует так же, как и сама σ . Что и требовалось доказать. ■

A.1.7. Транспозиции

Определение. Транспозицией называется цикл длины 2. Записывается как $\tau = (i \ j)$, где i и j — элементы, которые меняются местами.

Предложение. Любая перестановка может быть разложена в произведение транспозиций.

Доказательство: \square Разложим перестановку $\sigma \in S_n$ в произведение попарно независимых циклов:

$$\sigma = \sigma_1 \cdot \sigma_2 \dots \cdot \sigma_s \quad (1.29)$$

Достаточно показать, что любой цикл можно разложить в произведение транспозиций. Пусть цикл σ_i выглядит так:

$$\sigma_i = (i_1, i_2, \dots, i_l) \quad (1.30)$$

Тогда такой цикл можно записать как произведение цикла длины $(l - 1)$ и транспозиции двух последних номеров в орбите этого цикла:

$$\sigma_i = (i_1, i_2, \dots, i_{l-1}) \cdot (i_{l-1}, i_l) \quad (1.31)$$

Аналогично, можно разложить цикл длины $(l - 1)$ в произведение цикла длины $(l - 2)$ и транспозиции двух последних элементов. Продолжая далее этот алгоритм, мы дойдём до того, что в произведении останутся только транспозиции. Что и требовалось доказать. ■

A.1.8. Инверсии и знак перестановки

Определение. Назовём инверсией(беспорядком) в перестановке $\begin{pmatrix} 1 & 2 & \dots & n \\ i_1 & i_2 & \dots & i_n \end{pmatrix}$ пару (i_k, i_l) , где $k < l$, но $i_k > i_l$.

Определение. Перестановка чётна, если количество инверсий в ней чётно.

Определение. Перестановка нечётна, если количество инверсий в ней нечётно.

Определение. Знаком перестановки σ называется число

$$\operatorname{sgn}(\sigma) = \begin{cases} 1, & \text{если } \sigma \text{ чётна} \\ -1, & \text{если } \sigma \text{ нечётна} \end{cases} \quad (1.32)$$

Предложение. При транспозиции двух элементов перестановки её чётность меняется.

Доказательство. \square Пусть мы поменяли местами i_k и i_l .

1. Среди пар (i_p, i_q) , где $p, q \notin \{k, l\}$, количество инверсий не меняется.
2. Среди пар (i_p, i_k) , где $p < k \vee p > l$ не меняется.
3. Среди пар (i_p, i_l) , где $p < k \vee p > l$ тоже не меняется.
4. Среди пар (i_q, i_k) , где $k < q < l$, количество инверсий меняется на $\pm 1 \pm 1 \pm \dots \pm 1$, таких пар $l - k - 1$.
5. Среди пар (i_q, i_l) , где $k < q < l$, количество инверсий меняется на $\pm 1 \pm 1 \pm \dots \pm 1$, таких пар $l - k - 1$.
6. В паре (i_k, i_l) инверсия либо появляется, либо исчезает.

Общее изменение количества инверсий равно $2(l - k - 1) + 1 \equiv 1 \pmod{2}$, поэтому чётность перестановки изменилась. ■

Следствие. Количество чётных и нечётных перестановок в S_n одинаково и равно $\frac{n!}{2}$.

Доказательство. \square Установим взаимно однозначное соответствие между чётными и нечётными перестановками. Для этого рассмотрим чётную перестановку $\sigma \in S_n$:

$$\sigma = \begin{pmatrix} 1 & 2 & \dots & n \\ i_1 & i_2 & \dots & i_n \end{pmatrix} \xrightarrow{i_1 \leftrightarrow i_2} \begin{pmatrix} 1 & 2 & \dots & n \\ i_2 & i_1 & \dots & i_n \end{pmatrix} \quad (1.33)$$

Следовательно, чётных и нечётных поровну. ■

Предложение. Если перестановка σ разложена в произведение N транспозиций, то можно найти её знак.

$$\sigma = \tau_1 \cdot \tau_2 \cdots \cdot \tau_N \Rightarrow \operatorname{sgn}(\sigma) = (-1)^N \quad (1.34)$$

Доказательство. \square Проведём индукцию по числу множителей.

1. База: $N = 0$. $\sigma = e \Rightarrow \operatorname{sgn}(\sigma) = 1$ — верно.
2. Шаг. Пусть

$$\sigma = \tau_1 \cdot \tau_2 \cdots \cdot \tau_{N-1} \cdot \tau_N \quad (1.35)$$

Обозначим $\sigma' = \tau_1 \cdot \tau_2 \cdots \cdot \tau_{N-1}$. Пусть $\tau_N = (k, l)$. Действие σ' на все числа, кроме k и l , такое же, как у σ . Для k и l под действием σ получаем:

$$k \rightarrow l \rightarrow i_l \quad (1.36)$$

$$l \rightarrow k \rightarrow i_K \quad (1.37)$$

Но σ' действует так: $k \rightarrow i_k$, $l \rightarrow i_l$, значит перестановки σ и σ' отличаются транспозицией i_k и i_l , а значит их знаки различны по доказанному выше предложению.

$$\operatorname{sgn}(\sigma) = -\operatorname{sgn}(\sigma') \stackrel{\substack{\text{предп.} \\ \text{инд.}}}{=} -(-1)^{N-1} = (-1)^N. \quad (1.38)$$

Переход доказан и вместе с ним и утверждение $\forall N \in \mathbb{N}$. ■

Предложение. Мультипликативное свойство знака:

$$\operatorname{sgn}(\sigma \cdot \sigma') = \operatorname{sgn}(\sigma) \cdot \operatorname{sgn}(\sigma') \quad (1.39)$$

Доказательство. \square Пусть перестановки σ и σ' разложены на транспозиции:

$$\sigma = \tau_1 \cdot \tau_2 \cdot \cdots \cdot \tau_k \quad (1.40)$$

$$\sigma' = \pi_1 \cdot \pi_2 \cdot \cdots \cdot \pi_s. \quad (1.41)$$

Тогда, напрямую умножив их, получим

$$\begin{aligned} \operatorname{sgn}(\sigma \sigma') &= \operatorname{sgn}(\tau_1 \cdot \tau_2 \cdot \cdots \cdot \tau_k \cdot \pi_1 \cdot \pi_2 \cdot \cdots \cdot \pi_s) = \\ &= (-1)^{k+s} = (-1)^k \cdot (-1)^s = \operatorname{sgn}(\sigma) \cdot \operatorname{sgn}(\sigma'). \end{aligned} \quad (1.42)$$

■

Предложение. Знак обратной перестановки:

$$\operatorname{sgn}(\sigma^{-1}) = \operatorname{sgn}(\sigma) \quad (1.43)$$

Доказательство. \square Согласно мультипликативности знака перестановки получаем:

$$\operatorname{sgn}(e) = \operatorname{sgn}(\sigma \cdot \sigma') = \operatorname{sgn}(\sigma) \cdot \operatorname{sgn}(\sigma') \quad (1.44)$$

Но $\operatorname{sgn}(e) = 1$, поэтому

$$\operatorname{sgn}(\sigma) \cdot \operatorname{sgn}(\sigma') = 1 \Rightarrow \operatorname{sgn}(\sigma) = \operatorname{sgn}(\sigma'). \quad (1.45)$$

Что и требовалось доказать. ■

A.2. Комплексные числа

Определение. Полем комплексных чисел \mathbb{C} называется поле, удовлетворяющее следующим аксиомам:

1. $\mathbb{R} \subset \mathbb{C}$
2. Мнимая единица. $\exists i \in \mathbb{C} : i^2 = -1$
3. Аксиома минимальности. $(\mathbb{R} \subseteq K \subseteq \mathbb{C}) \wedge (i \in K) \Rightarrow K = \mathbb{C}$.

A.2.1. Алгебраическая форма записи

 **Теорема.** $\forall z \in \mathbb{C} \exists! x, y \in \mathbb{R}$:

$$z = x + i \cdot y \quad (2.1)$$

Причём x называется *действительной частью* числа z и обозначается $\operatorname{Re}(z)$, а y — *мнимой частью* числа z и обозначается $\operatorname{Im}(z)$.

Доказательство. \square Существование. Пусть $K = \{x + i \cdot y \mid x, y \in \mathbb{R}\}$. Тогда

1. $\mathbb{R} \subset K$, так как $\forall x \in \mathbb{R} : x = (x + i \cdot 0) \in K$.

2. $i \in K$, так как $i = (0 + i \cdot 1) \in K$.

3. K — подполе \mathbb{C} . Докажем это:

3.1. Замкнутость относительно сложения. Пусть $z_1 = x_1 + i \cdot y_1 \in K$, $z_2 = x_2 + i \cdot y_2 \in K$. Тогда

$$z_1 + z_2 = (x_1 + x_2) + i \cdot (y_1 + y_2) \in K \quad (2.2)$$

3.2. Замкнутость относительно умножения. Пусть $z_1 = x_1 + i \cdot y_1 \in K$, $z_2 = x_2 + i \cdot y_2 \in K$. Тогда

$$z_1 z_2 = (x_1 x_2 - y_1 y_2) + i \cdot (x_1 y_2 + x_2 y_1) \in K \quad (2.3)$$

3.3. Если $0 \neq z \in K$, то $z^{-1} \in K$. Пусть $z = x + i \cdot y$. Тогда

$$z^{-1} = \frac{x - i \cdot y}{x^2 + y^2} = \left(\frac{x}{x^2 + y^2} \right) + i \cdot \left(-\frac{y}{x^2 + y^2} \right) \in K \quad (2.4)$$

Таким образом, $\mathbb{R} \subset K \subseteq \mathbb{C}$, по аксиоме минимальности $K = \mathbb{C}$.

Единственность. Пусть $z = x_1 + i \cdot y_1 = x_2 + i \cdot y_2$. Тогда $(x_1 - x_2) + i \cdot (y_1 - y_2) = 0$. Следовательно, $x_1 - x_2 = 0$ и $y_1 - y_2 = 0$, то есть $x_1 = x_2$ и $y_1 = y_2$. ■

A.2.2. Единственность поля комплексных чисел

 **Теорема.** Поле комплексных чисел единствено с точностью до изоморфизма.

Доказательство. \square Пусть \mathbb{C}' – другое поле комплексных чисел, тогда оно удовлетворяет аксиомам:

1. $\mathbb{R}' \subset \mathbb{C}'$
2. $\exists i' \in \mathbb{C}' : (i')^2 = -1$
3. $(\mathbb{R} \subseteq K' \subseteq \mathbb{C}') \wedge (i' \in K') \Rightarrow K' = \mathbb{C}'$.

Заменив \mathbb{R}' на изоморфное поле \mathbb{R} , можем считать, что $\mathbb{R} \subset \mathbb{C}'$. Рассмотрим отображение $\varphi : \mathbb{C} \rightarrow \mathbb{C}'$, определённое следующим образом:

$$\forall z = x + i \cdot y \in \mathbb{C} : \varphi(z) = x + i' \cdot y, \quad (2.5)$$

где $i' \in \mathbb{C}'$ – мнимая единица в \mathbb{C}' . Покажем, что φ – изоморфизм полей. Отображение φ биективно, в силу существования и единственности алгебраической формы комплексного числа в обоих полях. Так же φ сохраняет операции сложения и умножения, так как операции над числами сводятся к операциям над их действительными и мнимыми частями, а они сохраняются изоморфизмом $\mathbb{R} \simeq \mathbb{R}'$. Таким образом, φ – изоморфизм полей. ■

A.2.3. Существование поля комплексных чисел

 *Теорема.* Существует поле комплексных чисел, причём

$$\mathbb{C} = \mathbb{R}^2 \quad (2.6)$$

Доказательство. Рассмотрим множество всех упорядоченных пар действительных чисел $\mathbb{R}^2 = \{(x, y) \mid x, y \in \mathbb{R}\}$. Определим на этом множестве операции сложения и умножения следующим образом:

1. $\forall (x_1, y_1), (x_2, y_2) \in \mathbb{R}^2 : (x_1, y_1) + (x_2, y_2) = (x_1 + x_2, y_1 + y_2)$
2. $\forall (x_1, y_1), (x_2, y_2) \in \mathbb{R}^2 : (x_1, y_1) \cdot (x_2, y_2) = (x_1 x_2 - y_1 y_2, x_1 y_2 + x_2 y_1)$

Проверим, что \mathbb{R}^2 с такими операциями образует поле.

1. Коммутативность сложения и умножения очевидна.
2. Ассоциативность сложения очевидна.
3. Ассоциативность умножения. Пусть даны три элемента $(x_1, y_1), (x_2, y_2), (x_3, y_3) \in \mathbb{R}^2$. Действительно,

$$\begin{aligned}
((x_1, y_1) \cdot (x_2, y_2)) \cdot (x_3, y_3) &= (x_1 x_2 - y_1 y_2, x_1 y_2 + x_2 y_1) \cdot (x_3, y_3) = \\
&= ((x_1 x_2 - y_1 y_2)x_3 - (x_1 y_2 + x_2 y_1)y_3, (x_1 x_2 - y_1 y_2)y_3 + (x_1 y_2 + x_2 y_1)x_3) = \\
&= (x_1(x_2 x_3 - y_2 y_3) - y_1(x_2 y_3 + x_3 y_2), x_1(x_2 y_3 + x_3 y_2) + y_1(x_2 x_3 - y_2 y_3)) = \\
&= (x_1, y_1) \cdot (x_2 x_3 - y_2 y_3, x_2 y_3 + x_3 y_2) = (x_1, y_1) \cdot ((x_2, y_2) \cdot (x_3, y_3))
\end{aligned} \tag{2.7}$$

4. Дистрибутивность проверяется аналогично.

5. Нулевой элемент: $(0, 0)$

6. Единичный элемент: $(1, 0)$

7. Противоположный элемент: $\forall (x, y) \in \mathbb{R}^2 : -(x, y) = (-x, -y)$

8. Обратный элемент: Пусть $(x, y) \in \mathbb{R}^2$, причём $(x, y) \neq (0, 0)$. Тогда

$$(x, y)^{-1} = \left(\frac{x}{x^2 + y^2}, -\frac{y}{x^2 + y^2} \right) \tag{2.8}$$

Таким образом, множество \mathbb{R}^2 с определёнными операциями образует поле.

Теперь установим, что $\mathbb{R}^2 = \mathbb{C}$.

9. Рассмотрим $\mathbb{R}^2 \supset \mathbb{R} \times \{0\} = \{(x, 0) \mid x \in \mathbb{R}\}$. Это подполе \mathbb{R}^2 , изоморфное \mathbb{R} через отображение $\psi : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^2, \forall x \in \mathbb{R} : \psi(x) = (x, 0)$.

$$9.1. (x_1, 0) + (x_2, 0) = (x_1 + x_2, 0)$$

$$9.2. (x_1, 0) \cdot (x_2, 0) = (x_1 x_2, 0)$$

10. Рассмотрим элемент $i = (0, 1) \in \mathbb{R}^2$. Легко видеть, что $i^2 = (0, 1) \cdot (0, 1) = (-1, 0)$.

11. Минимальность. Пусть $K \subset \mathbb{R}^2$ – подполе, содержащее $\mathbb{R} \times \{0\}$ и элемент $i = (0, 1)$. Тогда любой элемент $(x, y) \in \mathbb{R}^2$ можно записать как $(x, 0) + (0, 1) \cdot (y, 0)$, где $(x, 0), (y, 0) \in \mathbb{R} \times \{0\} \subset K$. Поскольку K – подполе, то $(x, y) \in K$. Таким образом, $K = \mathbb{R}^2$.

Таким образом, \mathbb{R}^2 является моделью поля комплексных чисел. ■

A.2.4. Геометрическая интерпретация комплексных чисел

Комплексному числу можно сопоставить точку в двумерном пространстве с декартовыми координатами (a, b) . По оси абсцисс откладывается действительная часть, по оси ординат – мнимая.

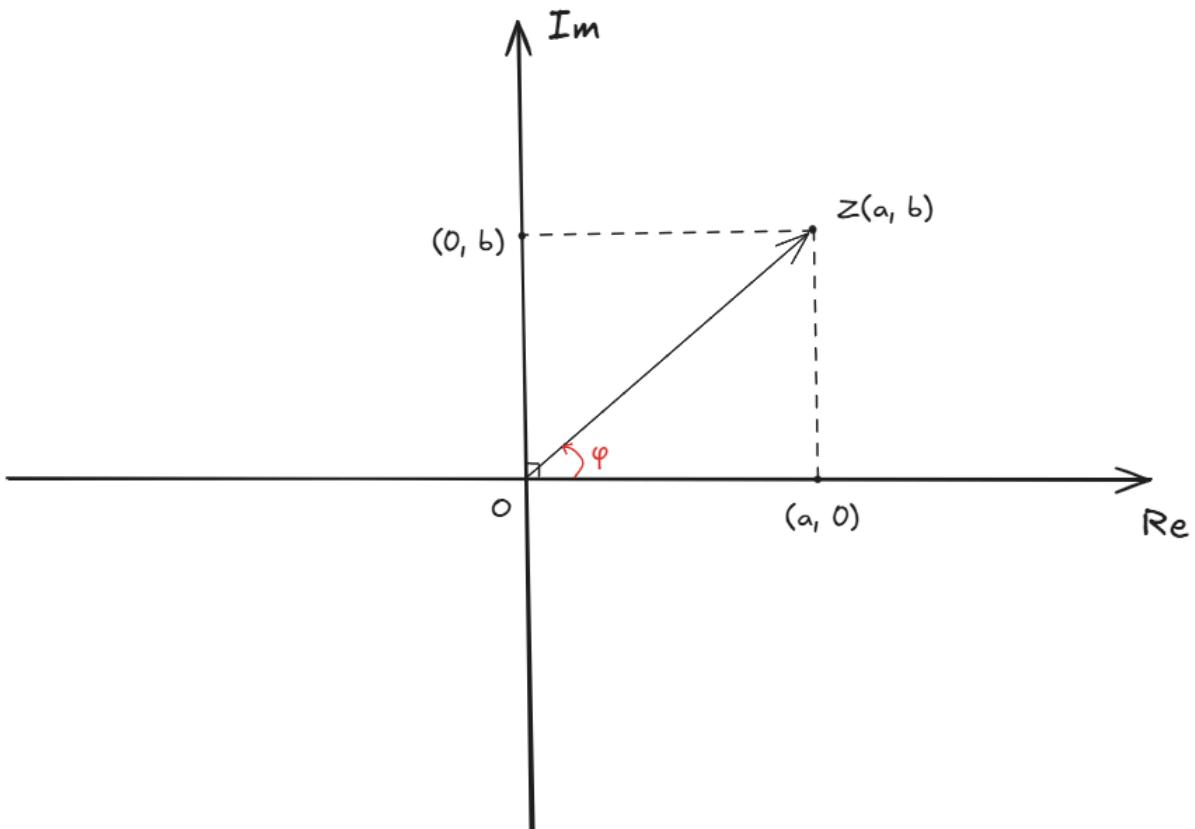


Рис. 1 - комплексная плоскость

Определение. Число $\bar{z} = a - bi$ называется *сопряжённым* числу $z = a + bi$. Операция сопряжения соответствует симметрии S_{\Re} относительно действительной оси.

A.2.5. Тригонометрическая форма записи

Определение. Величина $|z| = \sqrt{z\bar{z}} = \sqrt{a^2 + b^2}$ называется *модулем* z .

Определение. Многозначная функция $\text{Arg}(z) = \varphi$, где φ – ориентированный угол между радиус-вектором z и положительным направлением оси абсцисс называется *аргументом комплексного числа*. Аргумент числа $(0, 0)$ не определён.

Для однозначности определяют $\arg(z) \in [0, 2\pi]$. Она однозначна.

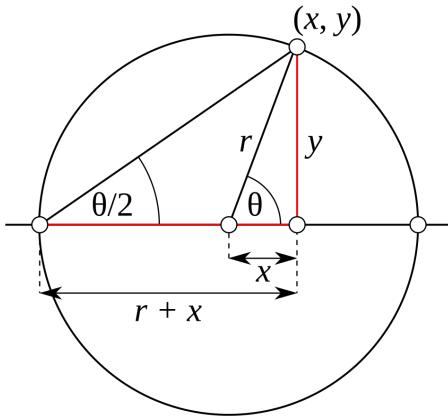
Пусть $z = x + yi$. Сделаем замену:

$$\begin{cases} r = |z| = \sqrt{x^2 + y^2} \\ \theta = \arg(z) \end{cases} \quad (2.9)$$

 *Теорема.* Явное выражение для значения аргумента из $(-\pi, \pi]$

$$\text{Arg}(z) = 2 \arctg \left(\frac{y}{x + \sqrt{x^2 + y^2}} \right) \quad (2.10)$$

Доказательство: \square Пусть комплексное число (x, y) имеет аргумент θ . Вписанный угол, опирающийся на дугу меры θ , равен половине центрального угла θ . Тогда из прямоугольного треугольника(см. рисунок).



$$\operatorname{tg}\left(\frac{\theta}{2}\right) = \frac{y}{x+r} \quad (2.11)$$

Это и эквивалентно $\theta = 2 \operatorname{arctg}\left(\frac{y}{x+r}\right)$. ■

A.2.6. Формы записи комплексных чисел

1. Алгебраическая:

$$z = x + yi \quad (2.12)$$

2. Тригонометрическая:

$$z = r(\cos \varphi + i \sin \varphi) \quad (2.13)$$

3. Показательная:

$$z = re^{i\varphi} \quad (2.14)$$

Показательная форма есть просто следствие формулы Эйлера:

$$e^{i\varphi} = \cos \varphi + i \sin \varphi \quad (2.15)$$

Доказательство самой формулы Эйлера вытекает из следующих трёх разложений.

$\forall z \in \mathbb{C}$

$$\sin z = z - \frac{z^3}{3!} + \frac{z^5}{5!} - \dots = \sum_{n=0}^{\infty} (-1)^n \frac{z^{2n+1}}{(2n+1)!} \quad (2.16)$$

$$\cos z = 1 - \frac{z^2}{2!} + \frac{z^4}{4!} - \dots = \sum_{n=0}^{\infty} (-1)^n \frac{z^{2n}}{(2n)!} \quad (2.17)$$

$$e^z = 1 + z + \frac{z^2}{2!} + \frac{z^3}{3!} + \dots = \sum_{n=0}^{\infty} \frac{z^n}{n!} \quad (2.18)$$

Подставим в разложение экспоненты $z = i\varphi$, где $\varphi \in \mathbb{R}$ и учтем следующие тождества: $i^2 = -1$, $i^3 = -i$, $i^4 = 1$, $i^5 = i$. Вообще говоря, $i^n = i^{n-4}$.

A.2.7. Умножение комплексных чисел в тригонометрической форме

Пусть даны два комплексных числа $z_1 = r_1(\cos \varphi_1 + i \sin \varphi_1)$ и $z_2 = r_2(\cos \varphi_2 + i \sin \varphi_2)$. Тогда их произведение можно записать в виде:

$$\begin{aligned} z_1 z_2 &= r_1 r_2 (\cos \varphi_1 + i \sin \varphi_1) (\cos \varphi_2 + i \sin \varphi_2) = \\ &= r_1 r_2 (\cos \varphi_1 \cos \varphi_2 - \sin \varphi_1 \sin \varphi_2 + i(\sin \varphi_1 \cos \varphi_2 + \cos \varphi_1 \sin \varphi_2)) = \quad (2.19) \\ &= r_1 r_2 (\cos(\varphi_1 + \varphi_2) + i \sin(\varphi_1 + \varphi_2)) \end{aligned}$$

Итак,

$$\begin{cases} |z_1 z_2| = |z_1| |z_2| \\ \arg(z_1 z_2) = \arg(z_1) + \arg(z_2) \end{cases} \quad (2.20)$$

Исходя из этого, можно быстро возводить комплексные числа в произвольную натуральную степень.



Теорема. Формула Муавра: $\forall z = r(\cos \varphi + i \sin \varphi) \in \mathbb{C}, n \in \mathbb{Z}$:

$$z^n = r^n (\cos(n\varphi) + i \sin(n\varphi)) \quad (2.21)$$

Доказательство. \square докажем по индукции.

1. База: $n = 1$. Тогда $z^1 = z = r(\cos \varphi + i \sin \varphi)$. Это уже получено.
2. Предположение индукции. Пусть верно для $n \in \mathbb{N}$: $z^n = r^n (\cos(n\varphi) + i \sin(n\varphi))$
3. Шаг индукции. Докажем для $n + 1$. Тогда

$$\begin{aligned} z^{n+1} &= z^n z = r^n r (\cos(n\varphi + \varphi) + i \sin(n\varphi + \varphi)) = \\ &= r^{n+1} (\cos((n+1)\varphi) + i \sin((n+1)\varphi)) \blacksquare \end{aligned} \quad (2.22)$$

Таким образом, формула верна для $n + 1 \Rightarrow$ она верна $\forall n \in \mathbb{N}$.

Чтобы доказать её для $n < 0$, достаточно написать $z^n = z^{-|n|}$. В случае $z \neq 0$ и $n = 0$ имеем $z^0 = 1$. ■

Умножение $z_1 = r_1(\cos \varphi_1 + i \sin \varphi_1)$ на $z_2 = r_2(\cos \varphi_2 + i \sin \varphi_2)$ задаёт композицию поворота $R_O^{\varphi_2}$ и гомотетии $H_O^{r_2}$ точки z_1 на плоскости \mathbb{C} . Полученное преобразование $\mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}^2$ называется *поворотной гомотетией*: $H_O^{r_2, \varphi_2} = H_O^{r_2} \cdot R_O^{\varphi_2}$.

A.2.8. Извлечение корней

Определение. Алгебраическим корнем числа $z \in \mathbb{C}$ называется множество $\Omega = \{w \mid w^n = z \mid w \in \mathbb{C}, n \in \mathbb{N}\}$ и обозначается $\sqrt[n]{z}$.

$$\forall z \in \mathbb{C} : |(\sqrt[n]{z})| = n.$$

Выведем формулу для корней из комплексного числа $z = r(\cos \varphi + i \sin \varphi)$.

Пусть $\sqrt[n]{z} = \{w_k \mid w_k^n = z \mid k = 0, 1, \dots, n - 1\}$.

1. Очевидно, что $|w_k| = \sqrt[r]{r}$, где $\sqrt[r]{r}$ – арифметический квадратный корень из действительного числа r . И правда, по формуле Муавра $|z| = |w_k|^n$.
2. Пусть $\varphi_k = \arg(w_k)$. Тогда по формуле Муавра: $n\varphi_k = \varphi + 2\pi k$. Для всех $k \in \{k_0 + i \mid i = 0, 1, \dots, (n - 1)\}$ будут получаться все n корней. Поэтому для удобства полагают $k_0 = 0$. ■

 *Теорема.* Формула корней числа $z = r(\cos \varphi + i \sin \varphi) \quad \forall k \in \{0, 1, \dots, n - 1\}$:

$$w_k = \sqrt[r]{r} \left(\cos \left(\frac{\varphi}{n} + 2\pi \frac{k}{n} \right) + i \sin \left(\frac{\varphi}{n} + 2\pi \frac{k}{n} \right) \right) \quad (2.23)$$

Все корни из числа z лежат на вершинах правильного n -угольника, вписанного в окружность с центром в начале координат и радиусом $\sqrt[r]{r}$.

Это легко видеть, исходя из того, что у всех корней одинаковый модуль, и каждый следующий получается из предыдущего поворотом на один и тот же угол $\frac{2\pi}{n}$.

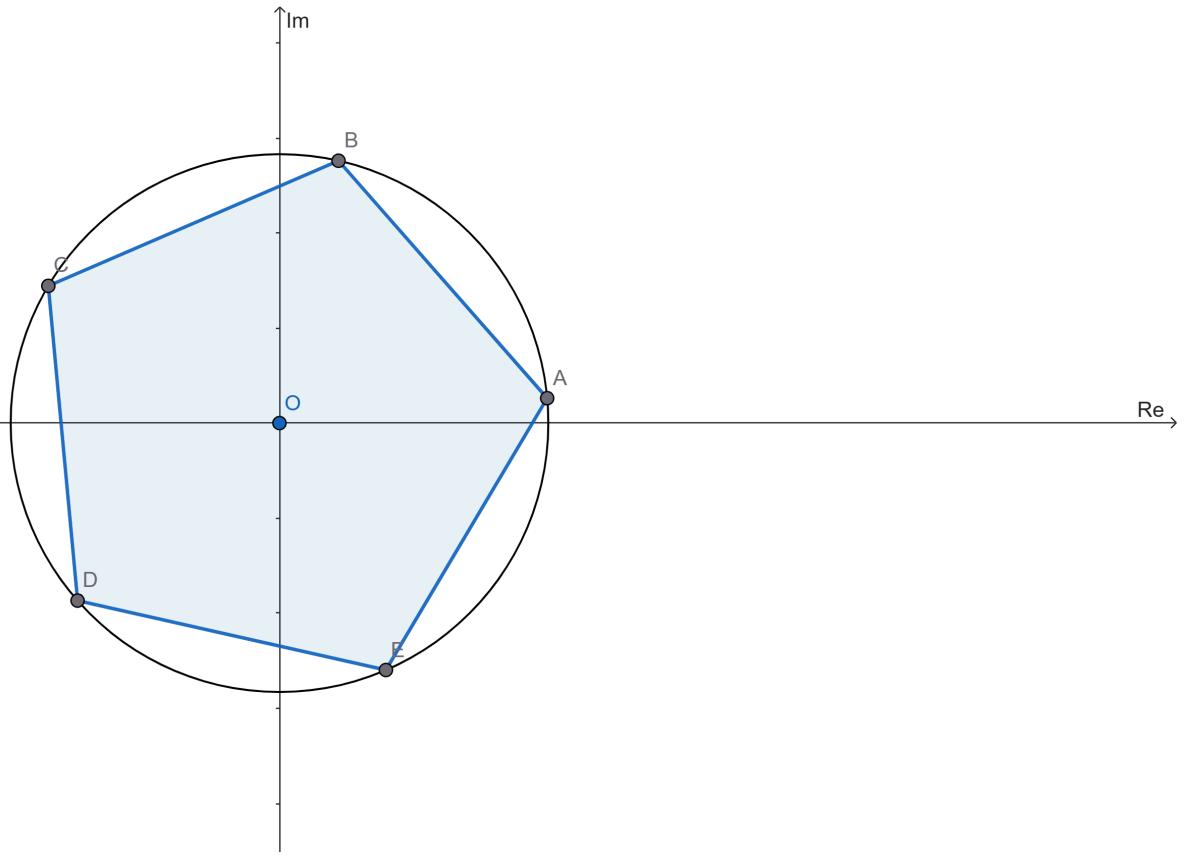


Рис. 2 – корни 5 степени из $z = 4 + 4i$

A.2.9. Корни из единицы

Положим $z = 1$. Тогда корни степени n выражаются так:

$$\sqrt[n]{1} = \varepsilon_k = \cos\left(\frac{2\pi k}{n}\right) + i \sin\left(\frac{2\pi k}{n}\right) \quad (2.24)$$

$$\forall k \in \{0, 1, \dots, n - 1\}.$$

Все корни есть вершины правильного n -угольника, вписанного в окружность единичного радиуса.

Свойства корней из единицы.

1. Если $\{w_k\}$ – корни n из комплексного числа z , то

$$w_k \cdot \varepsilon_l = w_{k+l \pmod{n}} \quad (2.25)$$

$$2. \quad \varepsilon_k \cdot \varepsilon_l = \varepsilon_{k+l \pmod{n}}$$

$$3. \quad \varepsilon_k^{-1} = \varepsilon_{n-k \pmod{n}}$$

4. Из свойств (2) и (3) следует, что множество корней степени n единицы с операцией умножения образует подгруппу мультиликативной группы \mathbb{C}^\times поля комплексных чисел.

$$\mathbb{U}_n = \{\varepsilon_k \mid k = 0, 1, \dots, n-1\} \subset \mathbb{C}^\times \quad (2.26)$$

5. $\mathbb{U}_n \simeq \mathbb{Z}_n$ — эта группа изоморфна аддитивной группе вычетов по модулю n через отображение $\varphi : \mathbb{Z}_n \rightarrow \mathbb{U}_n, \forall k \in \mathbb{Z}_n : \varphi(k) = \varepsilon_k$.

Определение. Первообразным корнем степени n из единицы называется такой корень из единицы, не являющийся корнем из единицы степени $m < n$.

Любой корень из единицы является первообразным для какой-то степени n .

 *Предложение.* Число $\varepsilon_k = \cos\left(\frac{2\pi k}{n}\right) + i \sin\left(\frac{2\pi k}{n}\right)$ является первообразным корнем степени n из единицы тогда и только тогда, когда $\gcd(k, n) = 1$.

Доказательство. \square Возьмём k -й корень из 1 в степень m :

$$\varepsilon_k^m = \varepsilon_{k \cdot m} = \cos\left(\frac{2\pi(k \cdot m)}{n}\right) + i \sin\left(\frac{2\pi(k \cdot m)}{n}\right) = 1 \Leftrightarrow n \mid (k \cdot m) \quad (2.27)$$

1. Пусть $\gcd(k, n) = 1$. Тогда $n \mid (k \cdot m) \Rightarrow n \mid m$. Следовательно, ε_k не является корнем из единицы степени $m < n$. Поэтому, ε_k — первообразный корень степени n из единицы.

2. Пусть $k = d \cdot l, n = d \cdot m$, где $d = \gcd(k, n) > 1$. Тогда

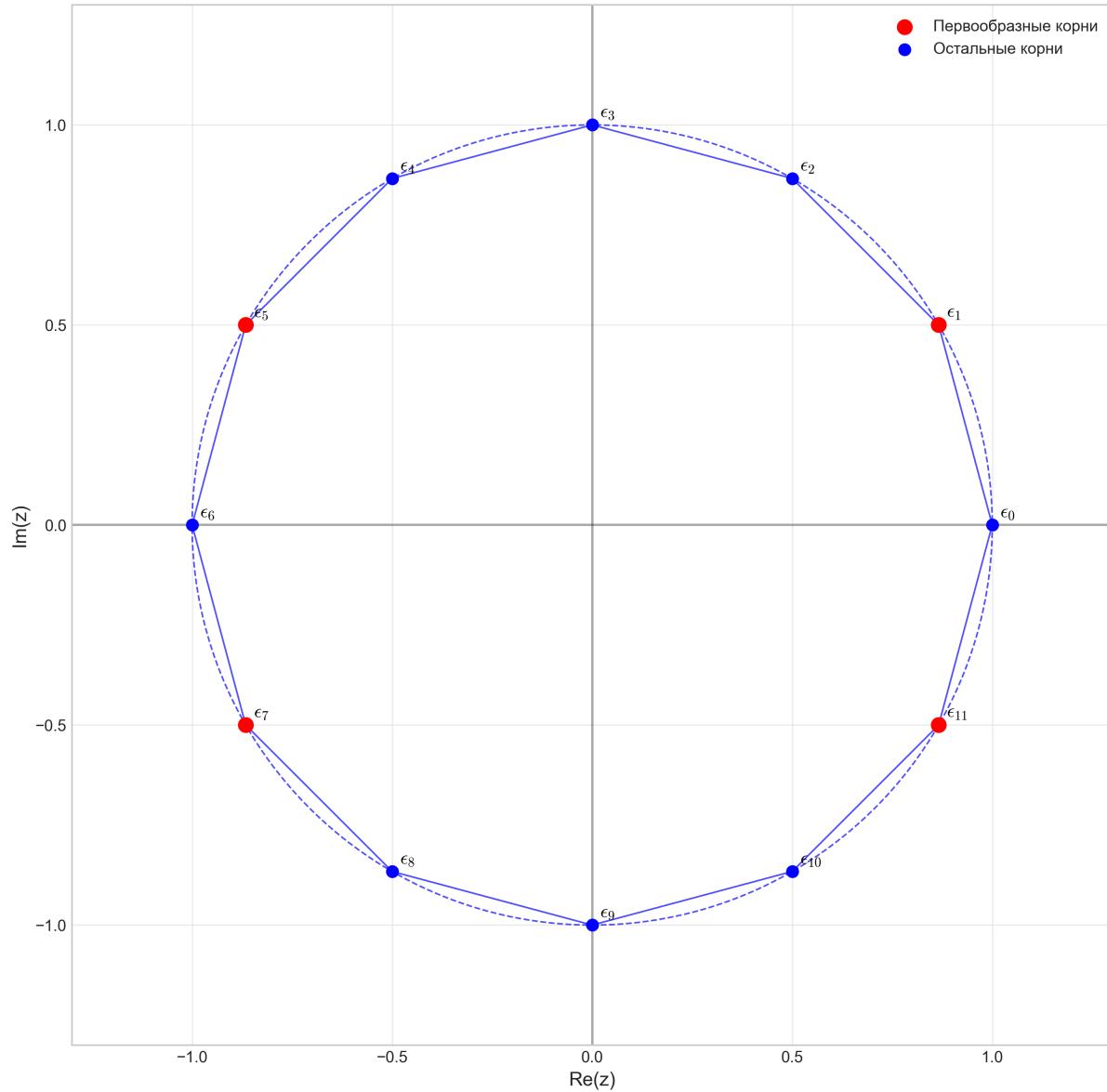
$$\begin{aligned} \varepsilon_k^m &= \varepsilon_{d \cdot l \cdot m} = \cos\left(\frac{2\pi(d \cdot l \cdot m)}{d \cdot m}\right) + i \sin\left(\frac{2\pi(d \cdot l \cdot m)}{d \cdot m}\right) = \\ &= \cos(2\pi l) + i \sin(2\pi l) = 1 \end{aligned} \quad (2.28)$$

Таким образом, ε_k является корнем из единицы степени $m < n$. Следовательно, ε_k не является первообразным корнем степени n из единицы. ■

Например, для $n = 12$ первообразными корнями из 1 являются $\varepsilon_1, \varepsilon_5, \varepsilon_7, \varepsilon_{11}$, так как $\gcd(1, 12) = 1, \gcd(5, 12) = 1, \gcd(7, 12) = 1, \gcd(11, 12) = 1$.

Количество первообразных корней степени n из единицы равно $\varphi(n)$, где φ — функция Эйлера.

Первообразные корни степени 12 из единицы



A.3. Системы линейных алгебраических уравнений

Определение. Система линейных (алгебраических) уравнений имеет вид:

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n = b_1 \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n = b_2 \\ \vdots \\ a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = b_m \end{cases} \quad (3.1)$$

где x_1, x_2, \dots, x_n - неизвестные, a_{ij} - коэффициенты для $i = 1, \dots, m$ и $j = 1, \dots, n$. И, наконец, b_i - свободные члены ($i = 1, \dots, n$).

Определение. Решением СЛУ называется упорядоченный набор чисел $(x_1^0, x_2^0, \dots, x_n^0)$, при подстановке которого вместо неизвестных, все уравнения обращаются в равенства.

Определение. СЛУ называется совместной, если у неё \exists решение.

Определение. СЛУ называется несовместной, если у неё \nexists решений.

Определение. СЛУ называется определённой, если у неё $\exists!$ решение.

Определение. СЛУ называется неопределённой, если у неё $\exists > 1$ решения.

Определение. Матрицей коэффициентов системы линейных уравнений называется прямоугольная таблица, составленная из всех коэффициентов при неизвестных в уравнениях системы.

$$A = \begin{pmatrix} a_{11}x_1 & a_{12}x_2 & \dots & a_{1n}x_n \\ a_{21}x_1 & a_{22}x_2 & \dots & a_{2n}x_n \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{m1}x_1 & a_{m2}x_2 & \dots & a_{mn}x_n \end{pmatrix} \quad (3.2)$$

Определение. Расширенной матрицей системы линейных уравнений называется матрица, полученная из матрицы коэффициентов добавлением столбца свободных членов.

$$\tilde{A} = \begin{pmatrix} a_{11}x_1 & a_{12}x_2 & \dots & a_{1n}x_n & b_1 \\ a_{21}x_1 & a_{22}x_2 & \dots & a_{2n}x_n & b_2 \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{m1}x_1 & a_{m2}x_2 & \dots & a_{mn}x_n & b_m \end{pmatrix} \quad (3.3)$$

A.3.1. Сложение и умножение строк

- Сложение двух строк:

$$(c_1, c_2, \dots, c_n) + (d_1, d_2, \dots, d_n) = (c_1 + d_1, c_2 + d_2, \dots, c_n + d_n) \quad (3.4)$$

- Умножение строки на число:

$$\lambda(c_1, c_2, \dots, c_n) = (\lambda c_1, \lambda c_2, \dots, \lambda c_n) \quad (3.5)$$

A.3.2. Элементарные преобразования систем линейных уравнений и их матриц

Определение. Элементарными преобразованиями системы линейных уравнений называются следующие операции:

1. Элементарные преобразования I типа. Прибавляем к одному уравнению другое, умноженное на некоторое число.

Символически:

$$(i)' = (i) + \lambda(j). \quad (3.6)$$

В терминах матриц:

$$\tilde{A}'_i = \tilde{A}_i + \lambda \cdot \tilde{A}_j \quad (3.7)$$

$$\tilde{A}'_k = \tilde{A}_k, \quad \forall k \neq i. \quad (3.8)$$

2. Элементарные преобразования II типа. Умножаем одно уравнение на некоторое число.

Символически:

$$(i) \leftrightarrow (j). \quad (3.9)$$

В терминах матриц:

$$\tilde{A}'_i = \tilde{A}_j \quad (3.10)$$

$$\tilde{A}'_j = \tilde{A}_i \quad (3.11)$$

$$\tilde{A}'_k = \tilde{A}_k, \quad \forall k \neq i, j. \quad (3.12)$$

3. Элементарные преобразования III типа. Умножение строки на ненулевое число.

Символически:

$$(i)' = \lambda \cdot (i), \quad \lambda \neq 0. \quad (3.13)$$

В терминах матриц:

$$\tilde{A}'_i = \lambda \cdot \tilde{A}_i, \quad \lambda \neq 0 \quad (3.14)$$

$$\tilde{A}'_k = \tilde{A}_k, \quad \forall k \neq i. \quad (3.15)$$

Предложение. Элементарные преобразования системы линейных уравнений не изменяют множество её решений.

Доказательство. \square Если из сходной СЛУ мы получили новую систему с помощью элементарных преобразований, то уравнения новой системы следуют из уравнений исходной системы:

- преобразования I типа для решения системы сохраняют верное равенство;
- преобразования II типа меняют только порядок записи;
- преобразования III типа не изменяют верное равенство.

Отсюда любое решение исходной системы является решением и новой системы. Теперь докажем, что любое решение новой системы является решением и исходной системы. Это происходит ввиду того, что \forall элементарного преобразования \exists обратное элементарное преобразование.

- Для I типа: $(i)' = (i) + \lambda(j) \Rightarrow (i) = (i)' - \lambda(j)$
- Для II типа: $(i)' = (j) \Rightarrow (i) = (j)'$
- Для III типа $(i)' = \lambda(i) \Rightarrow (i) = \frac{1}{\lambda}(i)'$

Применяя к обратным преобразованиям то же самое рассуждение, что и выше, мы и получим, что любое решение новой системы является решением и исходной системы. Следовательно, две системы эквивалентны. ■

A.3.3. Метод Гаусса решения систем линейных уравнений

Определение. Назовём *ведущим элементом* или же *лидером* числовые строки первый слева ненулевой элемент:

$$a_i : a_j = 0, \quad \forall j < i. \quad (3.16)$$

Метод Гаусса заключается в следующих шагах:

1. Выберем строку, лидер которой стоит на самой левой позиции.
2. Переставим эту строку с первой строкой с помощью элементарного преобразования II типа.
3. Обнулим коэффициент под лидером первой строки с помощью элементарного преобразования I типа.
4. Рассмотрим матрицу из всех строк, кроме первой: \bar{A} .
 - $\bar{A} = 0 \Rightarrow$ алгоритм завершается.
 - $\bar{A} \neq 0 \Rightarrow$ повторить шаги 1-4.

В итоге мы получим так называемую *ступенчатую матрицу*.

Определение. Ступенчатая матрица — это матрица, в которой:

- все ненулевые строки идут в начале
- все нулевые строки идут в конце
- лидер каждой ненулевой строки находится правее лидера предыдущей строки.

В качестве дополнительного шага, с помощью элементарных преобразований III типа мы можем сделать так, чтобы на местах лидеров всех строк были единицы.

Получим так называемый *улучшенный ступенчатый вид матрицы*.

A.3.4. Ранг ступенчатой матрицы

Определение. Ранг ступенчатой матрицы — это количество ненулевых строк в ней.

Пусть A^* — ступенчатая матрица, $r = \text{rank}(A^*)$ и $\tilde{r} = \text{rank}(\widetilde{A}^*)$. Рассмотрим 2 случая:

1. $r < \tilde{r} \Rightarrow \tilde{r} = r + 1$. В $(r+1)$ -м уравнении системы в левой части только нулевые коэффициенты, а в правой части лидер $(r+1)$ -й строки матрицы \widetilde{A}^* . Выходит: $0 = b_{r+1}^*$ — противоречивое уравнение. Итак, если ранг матрицы меньше ранга расширенной матрицы, то СЛУ несовместна.

2. $r = \tilde{r}$. Пусть номера столбцов, содержащих лидеров столбцов равны j_1, j_2, \dots, j_r .

Назовём

- $x_{j_1}, x_{j_2}, \dots, x_{j_r}$ — главные неизвестные,
- $(x_j), j \neq j_1, j_2, \dots, j_r$ — свободные неизвестные.

Обратный ход метода Гаусса. Рассмотрим r -е уравнение системы:

$$(r) \quad a_{r,j_r}^* + \dots = b_r^* \quad (3.17)$$

$$x_{j_r} = \frac{b_r^* - \sum_{j>j_r} a_{r,j}^* x_j}{a_{r,j_r}} \quad (3.18)$$

Выразили неизвестную x_{j_r} через свободные неизвестные. Поднимемся на $(r-1)$ -е уравнение.

$$(r-1) \Rightarrow x_{j_{r-1}} \text{ выражается через } x_j, j > j_{r-1}. \quad (3.19)$$

И так далее, поднимаясь до первого уравнения. В итоге мы выражаем главные неизвестные через свободные, получая общее решение.

$$x_{j_k} = \sum_{j \neq j_1, \dots, j_k} c_{kj} x_j + c_k, \quad \forall k = 1, \dots, r. \quad (3.20)$$

Подставляя конкретные значения для свободных неизвестных, мы получаем частное решение системы \Rightarrow СЛУ совместна.

A.3.5. Критерий совместности и определённости системы

Теорема. Пусть матрица СЛУ имеет ранг r , расширенная матрица имеет ранг \tilde{r} , а число неизвестных равно n . Тогда СЛУ:

- совместна $\Leftrightarrow r = \tilde{r}$
- несовместна $\Leftrightarrow r < \tilde{r}$
- определена $\Leftrightarrow r = \tilde{r} = n$
- неопределенна $\Leftrightarrow r = \tilde{r} < n$.

Доказательство. \square Осталось доказать критерии определённости и неопределённости. Пусть СЛУ совместна. Количество свободных неизвестных равно количеству неизвестных минус количество главных неизвестных: $(n - r)$.

- Если $n = r$, то свободных неизвестных нет, и тогда система определена. Если свободных неизвестных нет, то $r = n$.
- Если $n > r$, то свободные неизвестные есть, и тогда система неопределена.

■

A.3.6. Однородные системы линейных уравнений

Определение. Однородная система линейных уравнений — это система вида:

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n = 0 \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n = 0 \\ \vdots \\ a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = 0 \end{cases} \quad (3.21)$$

Однородная система линейных уравнений всегда совместна: нулевое решение $x_1 = x_2 = \dots = x_n = 0$.

Предложение. Однородная система линейных уравнений, в которой количество уравнений меньше количества неизвестных, всегда имеет ненулевое решение.

Доказательство. \square Приведём однородную систему к ступенчатому виду. Тогда $r = \tilde{r}$, поскольку система всегда совместна. Ранг не превосходит количества строк системы: $r \leq m < n$. По теореме Кронекера-Капелли, такая система неопределена, а значит кроме нулевого решения \exists ненулевое. ■

A.4. Векторные пространства

Определение. Векторным пространством называется множество V , на котором заданы две алгебраические операции – сложение векторов и умножение векторов на числа – которые удовлетворяют следующим аксиомам векторного пространства.

1. Коммутативность сложения: $\forall u, v \in V: u + v = v + u$.
2. Ассоциативность сложения: $\forall u, v, w \in V: (u + v) + w = u + (v + w)$.
3. Нулевой вектор: $\exists 0 \in V: \forall v \in V: v + 0 = v$. (иногда обозначается $\vec{0}$)
4. Противоположный вектор: $\forall v \in V: \exists w \in V: v + w = 0$.
5. Ассоциативность умножения: $\forall \lambda, \mu \in \mathbb{R}, v \in V: \lambda \cdot (\mu \cdot v) = (\lambda\mu) \cdot v$.
6. Дистрибутивность умножения относительно сложения векторов: $\forall \lambda \in \mathbb{R}, u, v \in V: \lambda \cdot (u + v) = \lambda \cdot u + \lambda \cdot v$.
7. Дистрибутивность умножения относительно сложения чисел: $\forall \lambda, \mu \in \mathbb{R}, v \in V: (\lambda + \mu) \cdot v = \lambda \cdot v + \mu \cdot v$.
8. Аксиома нормировки: $\forall v \in V: 1 \cdot v = v$.

A.4.1. Примеры векторных пространств

1. $V = \{\text{все свободные геометрические векторы пространства}\}$. На этом множестве геометрически определяются операции сложения и умножения на числа.
 - Сложение по правилу параллелограмма.
 - Умножение на число: $\forall \lambda \in \mathbb{R}, v \in V :$

$$|\lambda v| = |\lambda| |v| \quad (4.1)$$

$$\begin{cases} (\lambda v) \uparrow\uparrow v, & \text{если } \lambda > 0 \\ (\lambda v) \uparrow\downarrow v, & \text{если } \lambda < 0 \end{cases} \quad (4.2)$$

- Противоположный вектор: $\forall v \in V: v + (-v) = \vec{0}$.
2. Арифметическое векторное пространство: $V = \mathbb{R}^n$. Элементы этого множества это упорядоченные наборы (x_1, x_2, \dots, x_n) , $x_i \in \mathbb{R}$ ($i = 1, \dots, n$).
 - Сложение: $\forall u, v \in V: u + v = (u_1 + v_1, u_2 + v_2, \dots, u_n + v_n)$.
 - Умножение на число: $\forall \lambda \in \mathbb{R}, v \in V: \lambda \cdot v = (\lambda v_1, \lambda v_2, \dots, \lambda v_n)$.
 - Нулевой вектор: $(0, 0, \dots, 0)$.
 - Противоположный вектор: $\forall v = (v_1, v_2, \dots, v_n) \in V: -v = (-v_1, -v_2, \dots, -v_n)$.
 3. Пространство функций на множестве X : $V = \mathcal{F}(X, \mathbb{R}) = \{f: X \rightarrow \mathbb{R}\}$.

- сумма: $\forall f, g \in V, \forall x \in X : (f + g)(x) = f(x) + g(x)$.
- умножение на число: $\forall \lambda \in \mathbb{R}, f \in V, \forall x \in X : (\lambda \cdot f)(x) = \lambda \cdot (f(x))$.

A.4.2. Простейшие следствия из аксиом векторного пространства

1. Единственность нулевого вектора: $\exists!0 \in V$.

Доказательство. \square Пусть $0'$ – другой нулевой вектор. Рассмотрим их сумму: $0 + 0' = 0$ (так как $0'$ – нулевой вектор). Но $0 + 0' = 0'$ (так как 0 – нулевой вектор). Следовательно, $0 = 0'$. ■

2. Единственность противоположного вектора: $\forall v \in V : \exists!w \in V : v + w = 0$.

Доказательство. \square Пусть $w' \neq w$ – другой вектор, противоположный v . Рассмотрим $w + v + w'$:

$$(w + v) + w' = 0 + w' = w' \quad (4.3)$$

$$w + (v + w') = w + 0 = w \quad (4.4)$$

Следовательно, $w = w'$. Значит, противоположный вектор для данного только один. ■

- 2.1. Поэтому противоположный вектор для $v \in V$ можно обозначить: $(-v)$.
3. $\forall v \in V : 0 \cdot v = \vec{0}$.

Доказательство. \square $0 \cdot v = (0 + 0) \cdot v = 0 \cdot v + 0 \cdot v$. Добавим к обеим частям равенства $-(0 \cdot v)$, тогда получим: $\vec{0} = 0 \cdot v$ ■

4. $\forall \lambda \in \mathbb{R} : \lambda \cdot \vec{0} = 0$.

Доказательство. \square $\lambda \cdot \vec{0} = \lambda \cdot (\vec{0} + \vec{0}) = \lambda \cdot \vec{0} + \lambda \cdot \vec{0} \Rightarrow \lambda \cdot \vec{0} = 0$. ■

5. $\forall v \in V : (-1) \cdot v = -v$.

Доказательство. \square $v + (-1) \cdot v = 1 \cdot v + (-1) \cdot v = (1 + (-1)) \cdot v = 0 \cdot v = \vec{0}$.

■

A.4.3. Линейные комбинации

Определение. Линейной комбинацией векторов $v_1, v_2, \dots, v_n \in V$ с коэффициентами $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n \in \mathbb{R}$ называется выражение вида:

$$\lambda_1 \cdot v_1 + \lambda_2 \cdot v_2 + \dots + \lambda_n \cdot v_n \quad (4.5)$$

Её значение тоже вектор из V .

Определение. Тривиальной линейной комбинацией называется линейная комбинация, в которой все коэффициенты равны нулю: $\lambda_1 = \lambda_2 = \dots = \lambda_n = 0$. Её значение равно нулю.

Определение. Система векторов $S = \{v_1, v_2, \dots, v_n\}$ называется *зависимой*, если \exists нетривиальная линейная комбинация этих векторов, равная нулю.

A.4.3.1. Примеры линейных комбинаций

1. $S = \{v\}$ линейно зависима $\Leftrightarrow v = 0$.

Доказательство. \square

- $\lambda \cdot v = \vec{0} \Rightarrow v = \frac{1}{\lambda} \cdot \vec{0} = \vec{0}$.
- Обратно, $v = 0 \Rightarrow 1 \cdot v = \vec{0}$. ■

2. $S = \{v_1, v_2\}$ линейно зависима $\Leftrightarrow \exists \mu \in \mathbb{R} : v_1 = \mu \cdot v_2$.

Доказательство. \square

1) \Rightarrow Пусть $\lambda_1 \cdot v_1 + \lambda_2 \cdot v_2 = 0$ – нетривиальная линейная комбинация. Тогда $v_1 = -\frac{\lambda_2}{\lambda_1} \cdot v_2$ – векторы пропорциональны.

2) \Leftarrow Пусть $v_1 = \mu \cdot v_2$ для некоторого $\mu \in \mathbb{R}$. Тогда $v_1 + (-\mu) \cdot v_2 = 0$, что и означает зависимость векторов. ■

A.4.4. Свойства линейной зависимости

1. Если система векторов S линейно зависима и $S \subset S'$, то S' тоже линейно зависима.

Доказательство. \square Пусть $S = \{v_1, v_2, \dots, v_m\}$, $S' = \{v_1, \dots, v_m, v_{m+1}, \dots, v_n\}$.

Тогда \exists нетривиальная линейная комбинация векторов из S , равная нулю:

$$\lambda_1 \cdot v_1 + \lambda_2 \cdot v_2 + \dots + \lambda_m \cdot v_m = 0 \quad (4.6)$$

Добавим к ней векторы из $S' \setminus S$ с нулевыми коэффициентами:

$$\lambda_1 \cdot v_1 + \lambda_2 \cdot v_2 + \dots + \lambda_m \cdot v_m + 0 \cdot v_{m+1} + \dots + 0 \cdot v_n = 0 \quad (4.7)$$

Нетривиальная линейная комбинация векторов из S' равна нулю $\Rightarrow S'$ линейно зависима. ■

2. Если система векторов S линейно независима и $S' \subset S$, то S' тоже линейно независима.

Доказательство. \square Если бы S' была линейно зависима, то по свойству 1 S тоже была бы линейно зависима, что противоречит условию, поэтому S' линейно независима. ■

3. Система векторов S линейно зависима $\Leftrightarrow \exists v \in S: v$ равен линейной комбинации векторов из $S \setminus \{v\}$.

Доказательство. \square

1) \Rightarrow . Пусть $S = \{v_1, \dots, v_n\}$ и $\exists \lambda_i (i = 1, \dots, n)$:

$$\lambda_1 v_1 + \dots + \lambda_n v_n = 0, \quad \exists \lambda_j \neq 0. \quad (4.8)$$

Отсюда получим:

$$v_i = -\frac{\lambda_1}{\lambda_i} v_1 + \dots + \left(-\frac{\lambda_{i-1}}{\lambda_i} v_{i-1}\right) + \left(-\frac{\lambda_{i+1}}{\lambda_i} v_{i+1}\right) + \dots + \left(-\frac{\lambda_n}{\lambda_i} v_n\right) \quad (4.9)$$

2) \Leftarrow . Пусть $v_i = \mu_1 v_1 + \dots + \mu_{i-1} v_{i-1} + \mu_{i+1} v_{i+1} + \dots + \mu_n v_n$. Перенесём всё в правую часть:

$$\mu_1 v_1 + \dots + \mu_{i-1} v_{i-1} + (-1) \cdot v_i + \mu_{i+1} v_{i+1} + \dots + \mu_n v_n = 0. \quad (4.10)$$

■

4. Пусть S линейно независима, но $S \cup \{v\}$ линейно зависима $\Rightarrow v$ линейно выражается через S единственным способом.

Доказательство. \square Обозначим $S = \{v_1, \dots, v_n\}$. При добавлении v \exists нетривиальная ЛК, равная нулю:

$$\lambda_1 v_1 + \dots + \lambda_n v_n + \lambda v = 0. \quad (4.11)$$

Тогда $\lambda \neq 0$. Иначе, если бы $\lambda = 0$, мы получили бы

$$\lambda_1 v_1 + \dots + \lambda_n v_n = 0 \quad (4.12)$$

Но это противоречит линейной независимости S . Отсюда мы можем выразить v :

$$v = -\frac{\lambda_1}{\lambda} v_1 + \dots + \left(-\frac{\lambda_n}{\lambda} v_n\right) \quad (4.13)$$

Докажем единственность выражения через систему S . Пусть вектор v представляется двумя способами:

$$v = \alpha_1 v_1 + \dots + \alpha_n v_n \quad (4.14)$$

$$v = \beta_1 v_1 + \dots + \beta_n v_n \quad (4.15)$$

Отсюда, вычитая эти два равенства, получим

$$(\alpha_1 - \beta_1)v_1 + \dots + (\alpha_n - \beta_n)v_n = 0 \quad (4.16)$$

Система S линейно независима \Rightarrow в этой ЛК все коэффициенты равны нулю: $\alpha_i - \beta_i = 0 \Rightarrow \alpha_i = \beta_i, i = 1, \dots, n$. Значит вектор v выражается единственным способом. ■

5. Основная лемма о линейной зависимости. Пусть $S = \{v_1, \dots, v_n\}$ и $T = \{w_1, \dots, w_m\}$, причём система S линейно выражается через систему T и $n > m$. Тогда система S линейно зависима.

Доказательство. □ Если S линейно выражается через T , то $\forall j = 1, \dots, n$:

$$v_j = a_{1j}w_1 + \dots + a_{mj}w_m \quad (4.17)$$

Рассмотрим произвольную ЛК векторов системы S :

$$\begin{aligned} \lambda_1 v_1 + \lambda_2 v_2 + \dots + \lambda_n v_n &= \sum_{i=1}^n \lambda_i v_i = \sum_{j=1}^n \left(\lambda_j \cdot \sum_{i=1}^m a_{ij} w_i \right) = \\ &= \sum_{\substack{i=1, \dots, m \\ j=1, \dots, n}} a_{ij} \lambda_j \cdot w_i = \sum_{i=1}^m \left(\sum_{j=1}^n a_{ij} \lambda_j \right) w_i. \end{aligned} \quad (4.18)$$

Рассмотрим однородную систему линейных уравнений:

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n = 0 \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n = 0 \\ \vdots \\ a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = 0 \end{cases} \quad (4.19)$$

Здесь $m < n$, то есть число неизвестных больше числа уравнений. Мы знаем, что [такая система всегда имеет ненулевое решение](#). $\exists(x_1^0, \dots, x_n^0) = (\lambda_1, \dots, \lambda_n)$, где хотя бы один из λ_i не равен нулю, такие, что $\forall i = 1, \dots, m$:

$$\sum_{j=1}^m a_{ij} \lambda_j = 0 \quad (4.20)$$

Но $a_{ij} \lambda_j$ это коэффициенты ЛК в ((4.18)), значит эта ЛК равна нулю.

$$\lambda_1 v_1 + \lambda_2 v_2 + \dots + \lambda_n v_n = 0 \quad (4.21)$$

И решение $(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ ненулевое! \Rightarrow система S линейно зависима! ■

A.4.5. Базис системы векторов

Возьмём систему векторов $S \subseteq V$ в векторном пространстве V . Рассмотрим конечную подсистему $B \subseteq S$. Следующие 2 условия эквивалентны:

1. B — максимальная линейно независимая подсистема S .
2. B линейно независима и $\forall v \in S$ вектор v линейно выражается через B .

Доказательство. □ Пусть $B = \{v_1, \dots, v_r\}$.

1. (1) \Rightarrow (2).
 - Если $v \in B \Rightarrow v = v_i = 0 \cdot v_1 + \dots + 1 \cdot v_1 + \dots + 0 \cdot v_r$ — линейно выражены через B .
 - $v \in S \setminus B \Rightarrow B \cup \{v\}$ линейно зависима $\xrightarrow{\text{св. 4 ЛЗ}}$ v линейно выражается через S .
2. (2) \Rightarrow (1). $v \in S \setminus B \Rightarrow v$ линейно выражается через $B \xrightarrow{\text{св. 3 ЛЗ}}$ система $B \cup \{v\}$ линейно зависима $\Rightarrow B$ — максимальная подсистема S . ■

Определение. Конечная подсистема $B \subseteq S$, удовлетворяющая любому из условий (1) или (2), называется *базисом* системы векторов S .

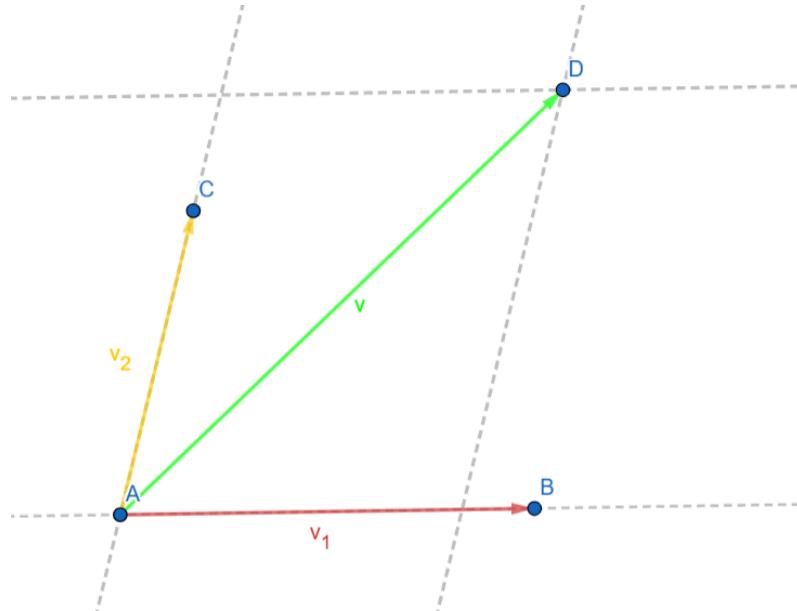
A.4.5.1. Примеры базисов

1. Рассмотрим

$V = \{\text{множество всех геометрических векторов на одной прямой}\}$. Здесь $B = \{v\}$, где v — любой ненулевой вектор из V . Например, по второму определению можно выразить $\forall u \in V \exists k \in \mathbb{R} : u = k \cdot v$.



2. Пусть $V = \{\text{множество всех геометрических векторов на плоскости}\}$. Тогда $B = \{v_1, v_2\}$, где v_1 и v_2 неколлинеарны. Это множество является базисом, опять же, по определению 2: $\forall v \in V \exists \alpha_1, \alpha_2 \in \mathbb{R} : v = \alpha_1 v_1 + \alpha_2 v_2$.



3. Рассмотрим $V = \{\text{множество всех геометрических векторов в пространстве}\}$.

Тогда $B = \{v_1, v_2, v_3\}$, где v_1, v_2 и v_3 некомпланарны. Это множество также является базисом, по определению 2: $\forall v \in V \exists \alpha_1, \alpha_2, \alpha_3 \in \mathbb{R} : v = \alpha_1 v_1 + \alpha_2 v_2 + \alpha_3 v_3$.

4. Рассмотрим арифметическое векторное пространство $V = \mathbb{R}^n$. Назовём стандартным базисом систему векторов $B = \{e_1, \dots, e_n\}$, где $e_i = (0, \dots, 0, 1_i, 0, \dots, 0)$ – вектор, у которого i -я координата равна 1, а все остальные равны 0.

Докажем линейную независимость векторов B :

$$\lambda_1 e_1 + \lambda_2 e_2 + \dots + \lambda_n e_n = (\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n) \neq 0, \text{ если } \exists \lambda_i \neq 0. \quad (4.22)$$

Мы можем выразить любой вектор $x \in \mathbb{R}^n$:

$$x = (x_1, x_2, \dots, x_n) = x_1 e_1 + x_2 e_2 + \dots + x_n e_n. \quad (4.23)$$

A.4.6. Единственность выражения через базисные векторы

Пусть задан базис $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ системы векторов S . Тогда $\forall v \in S \exists! \lambda_1, \dots, \lambda_n \in \mathbb{R} : v = \lambda_1 v_1 + \dots + \lambda_n v_n$.

Доказательство. \square

Существование. \Leftarrow (2) условие в определении базиса.

Единственность. Пусть есть два различных разложения по базису B :

$$v = \lambda_1 v_1 + \dots + \lambda_n v_n = \mu_1 v_1 + \dots + \mu_n v_n. \quad (4.24)$$

Тогда

$$(\lambda_1 - \mu_1)v_1 + \dots + (\lambda_n - \mu_n)v_n = 0. \quad (4.25)$$

Так как есть хотя бы одна пара (λ_i, μ_i) различных коэффициентов, то мы получили, что нетривиальная линейная комбинация базисных векторов равна нулю, что противоречит линейной независимости базиса. Значит разложение единствено. ■

Определение. Пусть в базисе $B = \{v_1, \dots, v_n\}$ системы векторов S вектор v выражается через базисные векторы:

$$v = \lambda_1 v_1 + \dots + \lambda_n v_n. \quad (4.26)$$

Числа $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ называются *координатами* вектора v в базисе B .

A.4.7. Базис системы векторов из \mathbb{R}^n

Предложение.

1. $\forall S \subseteq \mathbb{R}^n \exists$ базис.
2. Во всех базисах системы S одинаковое количество векторов, причём не больше n .

Доказательство. □

1. Если $S = \emptyset$ или $S = \{0\} \Rightarrow B = \{0\}$. Иначе в системе есть ненулевой вектор $v_1 \in S \Rightarrow \{v_1\}$ линейно независима.

1.1. Если система $\{v_1\}$ не максимальна, то расширим её до линейно независимой подсистемы, добавив вектор v_2 . Если она снова не максимальна, добавим v_3 и так далее. Получим возрастающую цепочку линейно независимых подсистем:

$$\{v_1\} \subset \{v_1, v_2\} \subset \{v_1, v_2, v_3\} \subset \dots \subset \{v_1, v_2, \dots, v_k\} \subset \dots \subseteq S \subseteq \mathbb{R}^n \quad (4.27)$$

Отсюда $\Rightarrow \forall \{v_1, \dots, v_k\}$ линейно выражается через $\{e_1, \dots, e_n\}$. По [основной лемме о линейной зависимости](#), $k \leq n \Rightarrow$ цепочка конечна. $\exists r \leq n : B = \{v_1, \dots, v_r\}$ — максимальная линейная независимая подсистема S , что и есть базис.

2. Докажем, что во всех базисах одинаковое количество векторов. Пусть $B' = \{w_1, \dots, w_s\}$ — другой базис системы S . Тогда его можно выразить через первый. По основной лемме о линейной зависимости, $s \leq r$. Но и B можно выразить через B' , поэтому $r \leq s$. Значит $r = s$. ■

A.4.8. Переход к новому базису

Пусть (e_1, \dots, e_n) и (e'_1, \dots, e'_n) — два базиса в V , причём $(e'_1, \dots, e'_n) = (e_1, \dots, e_n) \cdot C$.

Определение. Матрица C называется матрицей перехода от базиса (e_1, \dots, e_n) к базису (e'_1, \dots, e'_n) .

В j -м столбце матрицы C стоят координаты вектора e'_j в базисе (e_1, \dots, e_n) .

Предложение. Пусть $v \in V$ и $v = x_1 e_1 + \dots + x_n e_n$ и $v = x'_1 e'_1 + \dots + x'_n e'_n$ – вектор v выражается в двух разных базисах, причём $(e'_1, \dots, e'_n) = (e_1, \dots, e_n) \cdot C$. Тогда

$$\begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} = C \cdot \begin{pmatrix} x'_1 \\ \vdots \\ x'_n \end{pmatrix} \quad (4.28)$$

Доказательство. \square С одной стороны, $v = (e_1, \dots, e_n) \cdot \begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix}$. С другой стороны,

$$v = (e'_1, \dots, e'_n) \cdot \begin{pmatrix} x'_1 \\ \vdots \\ x'_n \end{pmatrix} = \cdot (e_1, \dots, e_n) \cdot C \cdot \begin{pmatrix} x'_1 \\ \vdots \\ x'_n \end{pmatrix}. \quad (4.29)$$

Так как (e_1, \dots, e_n) – линейно независимы, то вектор представленный их линейной комбинацией, представляется так единственным способом, поэтому

$$\begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} = C \cdot \begin{pmatrix} x'_1 \\ \vdots \\ x'_n \end{pmatrix} \blacksquare \quad (4.30)$$

Эту формулу можно использовать для пересчёта координат вектора при переходе к новому базису.

A.4.9. Подпространство векторного пространства

Определение. Подпространством векторного пространства V называется непустое множество векторов $U \subseteq V$, которое удовлетворяет двум требованиям замкнутости:

1. $\forall x, y \in U : x + y \in U$
2. $\forall x \in U, \lambda \in \mathbb{R} : \lambda \cdot x \in U$

A.4.9.1. Свойства подпространства

Пусть U – подпространство векторного пространства V .

1. $\vec{0} \in U$.

Доказательство. \square Так как U непусто, то $\exists u \in U$ и по второму свойству $0 \cdot u \in U$, но $0 \cdot u = \vec{0}$. \blacksquare

2. U само является векторным пространством относительно тех операций, что определены на множестве V .

3. Линейная оболочка системы векторов является подпространством. Пусть $S \subseteq V$.
Линеная оболочка системы S обозначается $\langle S \rangle$:

$$\langle S \rangle \stackrel{\text{def}}{=} \{v = \lambda_1 v_1 + \dots + \lambda_n v_n \mid \lambda_1, \dots, \lambda_n \in \mathbb{R}, v_1, \dots, v_n \in S\} \quad (4.31)$$

3.1. $\langle S \rangle$ является наименьшим подпространством, содержащим S .

3.2. Если B – базис S , то B – базис $\langle S \rangle$.

3.3. $\dim \langle S \rangle = \operatorname{rk} S$.

A.4.10. Фундаментальная система решений

 *Предложение.* Рассмотрим произвольную однородную систему линейных уравнений с матрицей коэффициентов A .

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n = 0 \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n = 0 \\ \vdots \\ a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = 0 \end{cases} \quad (4.32)$$

Тогда множество её решений $U \subseteq \mathbb{R}^n$ – подпространство, причём

$$\dim U = n - \operatorname{rk} A. \quad (4.33)$$

Доказательство. \square Докажем, что U является подпространством.

1. В силу однородности системы, $\vec{0} = (0, \dots, 0) \in U$
2. Пусть есть два решения системы: $y = (y_1, \dots, y_n)$ и $z = (z_1, \dots, z_n)$. Тогда $\forall i = 1, \dots, m$:

$$\begin{aligned} a_{i1}y_1 + a_{i2}y_2 + \dots + a_{in}y_n &= 0, \\ a_{i1}z_1 + a_{i2}z_2 + \dots + a_{in}z_n &= 0. \end{aligned} \quad (4.34)$$

Если мы сложим эти два равенства, то получим:

$$a_{i1}(y_1 + z_1) + a_{i2}(y_2 + z_2) + \dots + a_{in}(y_n + z_n) = 0. \quad (4.35)$$

Тогда $y + z \in U$ (тоже является решением системы).

3. Пусть $\lambda \in \mathbb{R}$. Если $y \in U$, то, умножая все уравнения на λ , получаем $\forall i = 1, \dots, m$:

$$a_{i1}(\lambda y_1) + a_{i2}(\lambda y_2) + \dots + a_{in}(\lambda y_n) = 0. \quad (4.36)$$

Таким образом, $y \in U \Rightarrow \lambda \cdot y \in U \Rightarrow U$ является подпространством. ■

Определение. Базис пространства решений однородной системы линейных уравнений называется *фундаментальной системой решений*.

A.4.11. Пересечение и сумма подпространств

Пусть V – векторное пространство над полем F , $\dim V < \infty$. И пусть $U, W \subseteq V$.

Тогда пересечение подпространств в теоретико-множественном смысле – тоже подпространство: $(U \cap W) \subseteq V$.

Доказательство. \square Проверяем:

1. $\vec{0} \in U, W \Rightarrow \vec{0} \in (U \cap W)$
2. $\forall x, y \in (U \cap W) : x, y \in U$ и $x, y \in W$. Поэтому $(x + y) \in U$ и $(x + y) \in W \Rightarrow (x + y) \in (U \cap W)$.
3. Пусть $\lambda \in F$. Тогда $\forall x \in (U \cap W) : x \in U, x \in W \Rightarrow \lambda \cdot x \in U, \lambda \cdot x \in W \Rightarrow \lambda \cdot x \in (U \cap W)$.

■

Определение. Суммой подпространств $U, W \subseteq V$ векторного пространства V называется множество

$$U + W := \{u + w \mid u \in U, w \in W\} \quad (4.37)$$



Предложение. Сумма подпространств – тоже подпространство в V .

Доказательство. \square Рассмотрим $u_1, u_2 \in U, w_1, w_2 \in W$. Надо проверить, что $[(u_1 + w_1) + (u_2 + w_2)] \in (U + W)$, но $(u_1 + w_1) + (u_2 + w_2) = (u_1 + u_2) + (w_1 + w_2)$. Аналогично проверяется замкнутость относительно умножения на скаляр: $\lambda \cdot (u + w) = \lambda \cdot u + \lambda \cdot w$. ■



Теорема. Пусть V – векторное пространство, U, W – подпространства V .

$$\dim(U \cap W) + \dim(U + W) = \dim U + \dim W \quad (4.38)$$

Доказательство. \square Пусть $\dim(U \cap W) = p$, $\dim U = q$, $\dim W = r$. Пусть $a = \{a_1, \dots, a_p\}$ – базис в $U \cap W$. Так как $(U \cap W) \subseteq U$ и $(U \cap W) \subseteq W$, то a можно дополнить до базиса в U и W : $\exists b = \{b_1, \dots, b_{q-p}\}$ и $\exists c = \{c_1, \dots, c_{r-p}\}$, такие что $a \cup b$ – базис U и $a \cup c$ – базис W . Докажем, что $a \cup b \cup c$ – базис в $U + W$.

1. Покажем, что $a \cup b \cup c = U + W$.

Если $v \in (U + W)$, то $v = u + w$, где $u \in U, w \in W$.

- $u \in \langle a \cup b \rangle \subseteq \langle a \cup b \cup c \rangle$.
- $w \in \langle a \cup c \rangle \subseteq \langle a \cup b \cup c \rangle$.
- $\Rightarrow (u + w) = v \in \langle a \cup b \cup c \rangle$.
- $\Rightarrow (U + W) \subseteq \langle a \cup b \cup c \rangle$.
- Обратно, $\langle a \cup b \cup c \rangle \subseteq (U + W)$, так как $\langle a \cup b \cup c \rangle = \underbrace{\langle a \rangle}_{\in U} + \underbrace{\langle b \rangle}_{\in U} + \underbrace{\langle c \rangle}_{\in W} \subseteq U + W$.

2. Проверим линейную независимость. Пусть $x = \alpha_1 a_1 + \dots + \alpha_p a_p$, $y = \beta_1 b_1 + \dots + \beta_{q-p} b_{q-p}$ и $z = \gamma_1 c_1 + \dots + \gamma_{r-p} c_{r-p}$. Пусть

$$x + y + z = \vec{0} \Rightarrow z = (-x - y) \in U. \quad (4.39)$$

С другой стороны, по определению $z \in W$, а следовательно, $z \in (U \cap W)$.

Поэтому $\exists \lambda_1, \dots, \lambda_p$:

$$z = \lambda_1 a_1 + \dots + \lambda_p a_p. \quad (4.40)$$

Итак,

$$\lambda_1 a_1 + \dots + \lambda_p a_p - \gamma_1 c_1 - \dots - \gamma_{r-p} c_{r-p} = \vec{0} \quad (4.41)$$

Но это ЛК векторов базиса $a \cup c$ пространства W . Поэтому $\lambda_1 = \dots = \lambda_p = \gamma_1 = \dots = \gamma_{r-p} = 0$. Поэтому $z = \vec{0}$, остаётся

$$\alpha_1 a_1 + \dots + \alpha_p a_p + \beta_1 b_1 + \dots + \beta_{q-p} b_{q-p} = \vec{0} \quad (4.42)$$

Это линейная комбинация векторов базиса $(a \cup b)$ пространства U . Значит $\alpha_1 = \dots = \alpha_p = \beta_1 = \dots = \beta_{q-p} = 0$.

Итак, $a \cup b \cup c$ – базис в $U + W$. Посчитаем размерность:

$$\begin{aligned} \dim(U + W) &= |a| + |b| + |c| = p + (q - p) + (r - p) = q + r - p = \\ &= \dim(U) + \dim(W) - \dim(U \cap W). \blacksquare \end{aligned} \quad (4.43)$$

A.5. Ранг системы векторов и ранг матрицы

A.5.1. Ранг системы векторов

Определение. Ранг системы векторов S — это количество векторов в любом её базисе. Обозначается $\text{rk } S$.

Определение. Размерность векторного пространства V — это его ранг. Обозначается $\dim V$.

Определение. Конечномерные векторным векторным пространством называется векторное пространство, в котором существует конечный базис.

Например, $\dim \mathbb{R}^n = n$.

Взаимно однозначное соответствие между V и \mathbb{R}^n позволяет отождествить их: $v \leftrightarrow (\lambda_1, \dots, \lambda_n)$.

A.5.1.1. Свойства ранга системы векторов

1. $S \subseteq S' \Rightarrow \text{rk } S \leq \text{rk } S'$.

Доказательство. \square Пусть B — базис S , тогда B — линейно независимая подсистема и S' , а значит $B \subseteq B'$, где B' — базис системы S' . Значит $B \subseteq B' \Rightarrow \text{rk } S \leq \text{rk } S'$. ■

2. Если S линейно выражается через S' , то $\text{rk } S \leq \text{rk } S'$.

Доказательство. \square Пусть B — базис в системе S , а B' — базис в системе S' . Тогда поскольку S линейно выражается через S' , то B можно выразить через B' . По основной лемме о линейной зависимости, $\text{rk } S \leq \text{rk } S'$. ■

3. Если две системы S и S' выражаются друг через друга(наз. линейно эквивалентными), то $\text{rk } S = \text{rk } S'$.

A.5.2. Ранг матрицы

A.5.2.1. Определение горизонтального, вертикального и ступенчатого ранга

Пусть A — матрица размера $m \times n$.

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \dots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & \dots & a_{2n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{m1} & a_{m2} & \dots & a_{mn} \end{pmatrix} \quad (5.1)$$

Её строки(длины n) обозначим: A_1, A_2, \dots, A_m .

Столбцы(высоты m): $A^{(1)}, A^{(2)}, \dots, A^{(n)}$.

Определение. Горизонтальный ранг матрицы A это ранг системы её строк.

$$r_{\text{г}} \underset{\text{def}}{=} \text{rk}\{A_1, A_2, \dots, A_m\} \quad (5.2)$$

Определение. Вертикальный ранг матрицы A это ранг системы её столбцов.

$$r_{\text{в}} \underset{\text{def}}{=} \text{rk}\{A^{(1)}, A^{(2)}, \dots, A^{(n)}\} \quad (5.3)$$

Приведём матрицу A к ступенчатому виду с помощью элементарных преобразований строк, получим A^* .

Определение. Ступенчатым рангом назовём количество ненулевых строк в матрице A^* .

Определение. Матрица A^T называется транспонированной матрицей A . Она получается отражением элементов матрицы A относительно главной диагонали.

$$A^T = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{21} & \dots & a_{m1} \\ a_{12} & a_{22} & \dots & a_{m2} \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{1n} & a_{2n} & \dots & a_{mn} \end{pmatrix} \quad (5.4)$$

Имеем $\forall i = 1..m, j = 1..n : a_{ij}^T = a_{ji}$.

$$r_{\text{г}}(A^T) = r_{\text{в}}(A), \quad (5.5)$$

$$r_{\text{в}}(A^T) = r_{\text{г}}(A). \quad (5.6)$$

A.5.2.2. Теорема о ранге матрицы

Теорема. Горизонтальный ранг матрицы равен вертикальному и равен ступенчатому рангу. Его можно обозначить $\text{rk}(A)$.

Доказательство. \square

1. Докажем, что $r_{\text{г}}(A)$ не меняется при элементарных преобразованиях строк. Если мы получили с помощью ЭП строк новую матрицу A' , то $\{A'_1, \dots, A'_m\}$ выражается через $\{A_1, \dots, A_m\}$ и наоборот. Значит эти системы линейно эквивалентны и их ранги равны.
2. Докажем, что $r_{\text{в}}(A)$ не меняется при элементарных преобразованиях строк. Рассмотрим однородную систему линейных уравнений:

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n = 0 \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n = 0 \\ \vdots \\ a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = 0 \end{cases} \quad (5.7)$$

Если $(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ – решение системы, то это равносильно тому, что $\forall i = 1, \dots, m$:

$$a_{i1}\lambda_1 + a_{i2}\lambda_2 + \dots + a_{in}\lambda_n = 0 \quad (5.8)$$

Перепишем это через столбцы:

$$A^{(1)}\lambda_1 + \dots + A^{(n)}\lambda_n = 0 \quad (5.9)$$

Ненулевые решения этой системы \Leftrightarrow линейная зависимость $A^{(1)}, \dots, A^{(n)}$. Если мы перейдём с помощью ЭП строк к матрице A' , то множество решений этой системы не изменится, и значит линейные зависимости между столбцами $A^{(1)}, \dots, A^{(n)}$ такие же, как у $A'^{(1)}, \dots, A'^{(n)}$. В частности, если $\{A^{(j_1)}, \dots, A^{(j_r)}\}$ – базис системы столбцов A , то столбцы с теми же номерами новой матрицы A' также будут образовывать базис. То есть вертикальный ранг и той и другой системы равен r .

3. Горизонтальный и вертикальный ранг сохраняются при элементарных преобразованиях столбцов. Поскольку ЭП столбцов $A \Leftrightarrow$ ЭП строк A^T .
4. Приведём матрицу A с помощью ЭП строк приведем к улучшенному ступенчатому виду A^* . Теперь на местах лидеров строк стоят единицы, под ступеньками нули а над лидерами тоже нули. Обозначим столбцы, проходящие через лидеров строк j_1, j_2, \dots, j_r . Её ступенчатый ранг равен r . Переставим(ЭП II типа) столбцы так, чтобы сначала шли только ненулевые строки. Обнулим все элементы, которые лежат не на главной диагонали с помощью ЭП I типа. Получим

$$A^{**} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & 1 & \dots \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & \dots & 0 \end{pmatrix} \quad (5.10)$$

Первые $r \times r$ элементов это единичная матрица размера r . Итак, $r_r(A) = r_r(A^{**}) = r$. Первые r строк это просто векторы e_i стандартного базиса \mathbb{R}^r . Аналогично, $r_b(A) = r_b(A^{**}) = r$. ■

A.5.3. Свойства ранга матрицы

В вышеприведенном доказательстве мы установили следующие свойства ранга матрицы.

1. $\text{rk}(A) \leq \min\{m, n\}$.
2. Ранг матрицы не меняется при элементарных преобразованиях строк и столбцов.
3. $\text{rk}(A) = \text{rk}(A^T)$.

A.6. Линейные отображения

Определение. Пусть даны два векторных пространства V и W . Отображение $\mathcal{A} : V \rightarrow W$ называется линейным, если выполнены два условия:

1. $x + y = \mathcal{A}(x) + \mathcal{A}(y), \forall x, y \in V.$
2. $\lambda \cdot x = \lambda \cdot \mathcal{A}(x), \forall \lambda \in \mathbb{R}, x \in V.$

По умолчанию будем считать, что линейные отображения действуют между арифметическими пространствами, то есть $\mathcal{A} : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$.

A.6.1. Матрица линейного отображения

Определение. Матрицей A линейного отображения \mathcal{A} называется матрица $m \times n$, такая, что

$$A^{(j)} = \mathcal{A}(e_i), \forall j = 1, \dots, n, \quad (6.1)$$

где e_1, \dots, e_n — векторы стандартного базиса пространства \mathbb{R}^n .

- Линейное отображение \mathcal{A} однозначно определяется своей матрицей A .

□ $\forall x \in \mathbb{R}^n : x = x_1 e_1 + \dots + x_n e_n$. Но $\mathcal{A}(x) = \mathcal{A}(x_1 e_1) + \dots + \mathcal{A}(x_n e_n) = x_1 \mathcal{A}(e_1) + \dots + x_n \mathcal{A}(e_n)$. $\mathcal{A}(e_i)$ — это столбцы нужной матрицы A . Обратно, если $x = x_1 A^{(1)} + \dots + x_n A^{(n)}$, то столбцы можно переписать как образы базисных векторов \mathbb{R}^n . ■

A.6.2. Алгебраические операции над линейными отображениями

1. Сложение. Пусть $\mathcal{A}, \mathcal{B} : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$, тогда $\forall x \in \mathbb{R}^n$

$$\mathcal{C} = \mathcal{A} + \mathcal{B} \Leftrightarrow \mathcal{C}(x) = \mathcal{A}(x) + \mathcal{B}(x) \quad (6.2)$$

Здесь \mathcal{C} отображает $\mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$.

2. Умножение на число. Пусть $\mathcal{A} : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$ и $\lambda \in \mathbb{R}$, тогда $\forall x \in \mathbb{R}^n$:

$$\mathcal{C} = \lambda \cdot \mathcal{A} \Leftrightarrow \mathcal{C}(x) = \lambda \cdot \mathcal{A}(x) \quad (6.3)$$

Здесь \mathcal{C} отображает $\mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$.

3. Умножение линейных отображений. Пусть $A : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$ и $B : \mathbb{R}^p \rightarrow \mathbb{R}^n$. Тогда $\mathcal{C} : \mathbb{R}^p \rightarrow \mathbb{R}^m$:

$$\mathcal{C} = \mathcal{A} \cdot \mathcal{B} \Leftrightarrow \mathcal{C}(x) = \mathcal{A}(\mathcal{B}(x)), \forall x \in \mathbb{R}^p \quad (6.4)$$

A.6.3. Алгебраические операции над матрицами

1. Сложение. Пусть A, B — матрицы $m \times n$. Для всех столбцов $\forall j = 1, \dots, n$:

$$C = A + B \Leftrightarrow C^{(j)} = A^{(j)} + B^{(j)} \quad (6.5)$$

Это следует из того, что для соответствующих линейных отображений

$$C^{(j)} = \mathcal{C}(e_j) = \mathcal{A}(e_j) + \mathcal{B}(e_j) = A^{(j)} + B^{(j)}. \quad (6.6)$$

Или же

$$c_{ij} = a_{ij} + b_{ij}, \quad (6.7)$$

где $i = 1, \dots, m; j = 1, \dots, n.$

2. Умножение на число. Пусть A - матрица $m \times n$ и $\lambda \in \mathbb{R}$, тогда для всех столбцов $\forall j = 1, \dots, n:$

$$C = \lambda \cdot A \Leftrightarrow C^{(j)} = \lambda \cdot A^{(j)} \quad (6.8)$$

Так как $\mathcal{C} = \lambda \cdot \mathcal{A}$, то для всех $j = 1, \dots, n:$

$$C = \lambda \cdot A \Leftrightarrow \mathcal{C}(e_j) = \lambda \cdot \mathcal{A}(e_j) \quad (6.9)$$

Или же

$$C = \lambda \cdot A \Leftrightarrow c_{ij} = \lambda \cdot a_{ij}, \quad (6.10)$$

где $i = 1, \dots, m; j = 1, \dots, n.$

3. Умножение матриц. Пусть матрица A имеет размер $m \times n$ и B имеет размер $n \times p$.

$$C = A \cdot B \Leftrightarrow C^{(j)} = \mathcal{C}(e_j), \forall j = 1, \dots, p \quad (6.11)$$

Так как $\mathcal{C} = \mathcal{A} \cdot \mathcal{B}$, то для всех $j = 1, \dots, p:$

$$\begin{aligned} \mathcal{C}(e_j) &= \mathcal{A}(\mathcal{B}(e_j)) = \mathcal{A}(B^{(j)}) = \mathcal{A}(b_{1j}e_1 + \dots + b_{nj}e_n) = \\ &= b_{1j}\mathcal{A}(e_1) + \dots + b_{nj}\mathcal{A}(e_n) = b_{1j}A^{(1)} + \dots + b_{nj}A^{(n)} \end{aligned} \quad (6.12)$$

Получаем поэлементно:

$$c_{ij} = \sum_{k=1}^n a_{ik} \cdot b_{kj}, \quad (6.13)$$

$\forall i = 1, \dots, m; j = 1, \dots, p$

Несложно доказать, что эти операции корректно определены на множестве линейных отображений.

A.6.4. Матричная запись линейного отображения

Пусть $\mathcal{A} : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$ и

$$x = \begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^n \quad (6.14)$$

тогда

$$y = \begin{pmatrix} y_1 \\ \vdots \\ y_m \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^m \quad (6.15)$$

$$y = \mathcal{A}(x) = \mathcal{A}(x_1 e_1 + \dots + e_n x_n) = A^{(1)} x_1 + \dots + A^{(n)} x_n \quad (6.16)$$

Для каждого элемента $y_i (i = 1, \dots, m)$:

$$y_i = a_{i1} x_1 + \dots + a_{in} x_n \quad (6.17)$$

Получаем **матричную запись** линейного отображения:

$$y = A \cdot x \quad (6.18)$$

Система линейных уравнений с матрицей коэффициентов A и столбцом свободных членов b и столбцом неизвестных x можно записать так:

$$A \cdot x = b \quad (6.19)$$

A.6.5. Свойства матричных операций

1. Коммутативность сложения:

$$A + B = B + A \quad (6.20)$$

2. Ассоциативность сложения:

$$(A + B) + C = A + (B + C) \quad (6.21)$$

3. Нулевая матрица:

$$O + A = A, \forall A \quad (6.22)$$

4. Ассоциативность умножения матрицы на число:

$$\lambda \cdot (\mu \cdot A) = (\lambda \cdot \mu) \cdot A \quad (6.23)$$

5. Дистрибутивность умножения матриц на числа относительно сложения:

5.1. Чисел:

$$(\lambda + \mu) \cdot A = \lambda \cdot A + \mu \cdot A \quad (6.24)$$

5.2. Матриц:

$$\lambda \cdot (A + B) = \lambda \cdot A + \lambda \cdot B \quad (6.25)$$

6. Умножение на нуль:

$$0 \cdot A = O \quad (6.26)$$

7. Умножение на нулевую матрицу:

$$\lambda \cdot O = O \quad (6.27)$$

8. Умножение на единицу:

$$1 \cdot A = A \quad (6.28)$$

9. Противоположная матрица:

$$A + (-A) = O \quad (6.29)$$

где $(-A) = (-1) \cdot A$.

- Таким образом, множество всех матриц $m \times n$ с операциями сложения и умножения на числа образует векторное пространство. Его элементы можно рассматривать как длинные векторы $m \times n$.

10. Ассоциативность умножения матриц:

$$A \cdot (B \cdot C) = (A \cdot B) \cdot C \quad (6.30)$$

11. Некоммутативность. Вообще говоря,

$$A \cdot B \neq B \cdot A \quad (6.31)$$

12. Смешанная ассоциативность:

$$(\lambda \cdot A) \cdot B = \lambda \cdot (A \cdot B) \quad (6.32)$$

13. Дистрибутивность матричного умножения относительно сложения:

13.1. Левая дистрибутивность:

$$A \cdot (B + C) = A \cdot B + A \cdot C \quad (6.33)$$

13.2. Правая дистрибутивность:

$$(A + B) \cdot D = A \cdot D + B \cdot D \quad (6.34)$$

A.6.6. Взаимодействие транспонирования и алгебраических операций над матрицами

Преуложение о транспонировании.

1. $(A + B)^T = A^T + B^T$
2. $(\lambda \cdot A)^T = \lambda \cdot A^T$
3. $(A \cdot B)^T = B^T \cdot A^T$

Доказательство. \square

1. Пусть $C = A + B$. Тогда $\forall i, j$:

$$c_{ij}^T = c_{ji} = a_{ji} + b_{ji} = a_{ij}^T + b_{ij}^T. \quad (6.35)$$

2. Пусть $C = \lambda \cdot A$, $\forall i, j$:

$$c_{ij}^T = c_{ji} = \lambda \cdot a_{ji} = \lambda \cdot a_{ij}^T. \quad (6.36)$$

3. Пусть $C = A \cdot B$, $\forall i, j$:

$$c_{ij}^T = c_{ji} = \sum_k a_{jk} \cdot b_{ki} = \sum_k a_{kj}^T \cdot b_{ik}^T = \sum_k b_{ik}^T \cdot a_{kj}^T \quad (6.37)$$

Отсюда $C^T = B^T \cdot A^T$. ■

A.6.7. Ранг произведения двух матриц

Теорема. Ранг произведения двух матриц не превосходит каждого из рангов сомножителей:

$$\operatorname{rk}(A \cdot B) \leq \min\{\operatorname{rk} A, \operatorname{rk} B\} \quad (6.38)$$

Доказательство. \square Пусть $A \in \operatorname{Mat}_{m,n}$, $B \in \operatorname{Mat}_{n,p} \Rightarrow A \cdot B = C \in \operatorname{Mat}_{m,p}$. $\forall i, j$:

$$c_{ij} = \sum_{k=1}^n a_{ik} \cdot b_{kj} \quad (6.39)$$

$$C_i = \sum_{k=1}^n a_{ik} \cdot B_k \quad (6.40)$$

Следовательно, система строк матрицы C линейно выражается через систему векторов B . Значит ранг системы строк матрицы C не превосходит ранга системы строк матрицы B . Значит, $\operatorname{rk} C \leq \operatorname{rk} B$. Аналогично, выражая систему столбцов $\{C^{(1)}, \dots, C^{(p)}\}$ через столбцы матрицы A :

$$C^{(j)} = \sum_{k=1}^n A^{(k)} \cdot b_{kj} \quad (6.41)$$

Значит $\operatorname{rk} C \leq \operatorname{rk} A$. ■

Аналогично можно показать, что

$$\operatorname{rk}(A + B) \leq \min\{\operatorname{rk} A, \operatorname{rk} B\}. \quad (6.42)$$

A.6.8. Тождественное отображение

Определение. Отображение $\mathcal{E} : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ называется тождественным, если

$$\mathcal{E}(x) = x, \forall x \in \mathbb{R}^n. \quad (6.43)$$

Матрица тождественного отображения:

$$E = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix} \quad (6.44)$$

Это так называемая *единичная матрица* размера $n \times n$.

Её элементы можно описать символом Кронекера:

$$\delta_{ij} = \begin{cases} 1, & \text{при } i = j \\ 0, & \text{при } i \neq j \end{cases} \quad (6.45)$$

A.6.8.1. Основное свойство тождественного отображения и единичной матрицы

Основное свойство тождественного отображения $\forall \mathcal{A} : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$

$$\mathcal{A} \cdot \mathcal{E} = \mathcal{A} \quad (6.46)$$

Аналогично, $\forall \mathcal{B} : \mathbb{R}^p \rightarrow \mathbb{R}^n$:

$$\mathcal{E} \cdot \mathcal{B} = \mathcal{B} \quad (6.47)$$

Из этого сразу следует основное свойство единичной матрицы:

$$A \cdot E = A, \forall A \in \operatorname{Mat}_{m,n} \quad (6.48)$$

$$E \cdot B = B, \forall B \in \operatorname{Mat}_{n,p} \quad (6.49)$$

A.6.9. Обратная матрица

Определение. Пусть $A \in \operatorname{Mat}_n$. Матрица $B \in \operatorname{Mat}_n$ называется обратной к матрице A , если

$$A \cdot B = B \cdot A = E. \quad (6.50)$$

Свойства обратной матрицы.

- Если обратная матрица к данной существует, то она ровно одна.

Доказательство. \square Пусть B и B' — две обратные матрицы к A .

$$B \cdot A \cdot B' = (B \cdot A) \cdot B' = E \cdot B' = B' \quad (6.51)$$

$$B \cdot A \cdot B' = B \cdot (A \cdot B') = B \cdot E = B \quad (6.52)$$

Поэтому $B = B'$. ■

- Обратную матрицу к матрице A обозначают A^{-1} .
- Если матрица $A \leftrightarrow \mathcal{A} : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$, то $A^{-1} \leftrightarrow \mathcal{A}^{-1} : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$. Кроме того, обратное отображение тоже линейно.
- Матрица A обратима $\Leftrightarrow \mathcal{A}$ обратимо $\Leftrightarrow \mathcal{A}$ биективно.

Предложение. Если A, B обратимы, то $A \cdot B$ обратимо и $(A \cdot B)^{-1} = B^{-1} \cdot A^{-1}$.

Доказательство. \square Рассмотрим $(A \cdot B) \cdot (B^{-1} \cdot A^{-1}) = A \cdot E \cdot A^{-1} = A \cdot A^{-1} = E$.

Аналогично, в другом порядке получим при умножении E . Поэтому эти матрицы взаимно обратны. ■

Определение. Квадратная матрица $A \in \text{Mat}_n$ называется *невырожденной*, если $\text{rk } A = n$.

Теорема. Матрица $A \in \text{Mat}_n$ обратима тогда и только тогда, когда она невырождена.

Доказательство. \square

- \Rightarrow . Пусть матрица A обратима. Тогда $A \cdot A^{-1} = E$. Мы знаем, что ранг произведения матриц не превосходит каждого из рангов сомножителей, значит

$$\text{rk}(A \cdot A^{-1}) \leq \min\{\text{rk } A, \text{rk } A^{-1}\} \quad (6.53)$$

$$n \leq \text{rk } A \quad (6.54)$$

Поэтому $\text{rk } A = n$. И матрица A невырождена.

- \Leftarrow . Пусть $\text{rk } A = n$. Тогда столбцы $\{A^{(1)}, \dots, A^{(n)}\}$ линейно независимы. И они образуют базис в \mathbb{R}^n . Если бы эта система векторов была не максимальной, в ней было бы $> n$ векторов, но в любом пространстве V с $\dim V = n$ базис имеет ровно n векторов.

Тогда

$$\forall y \in \mathbb{R}^n \exists! x_1, \dots, x_n : y = \sum_{i=1}^n x_i \cdot A^{(i)} \quad (6.55)$$

значит

$$\forall y \in \mathbb{R}^n \exists! x \in \mathbb{R}^n : y = \mathcal{A}(x), \quad (6.56)$$

где $\mathcal{A} : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ – линейное отображение. Значит A взаимно однозначно \Rightarrow обратимо \Rightarrow матрица этого отображения обратима.

■

A.6.10. Алгоритм нахождения обратной матрицы

Пусть A – невырожденная матрица. Запишем расширенную матрицу $(A | E)$ и приведём к улучшенному ступенчатому виду матрицу A . Её улучшенный ступенчатый вид будет E . Утверждается, что матрица, которая получена с помощью элементарных преобразований на месте E будет A^{-1} .

$$(A | E) \xrightarrow[\text{строк}]{\substack{\text{элементарные} \\ \text{преобразования}}} (E | A^{-1}) \quad (6.57)$$

Доказательство. $\square X = A^{-1}$ является решением уравнения $A \cdot X = E$. Это уравнение равносильно системе:

$$\begin{cases} A \cdot X^{(j)} = E^{(j)} \\ \forall j = 1, \dots, n \end{cases} \quad (6.58)$$

Каждое из уравнений на $X^{(j)}$ есть матричная запись СЛАУ с матрицей коэффициентов A и свободным членом $E^{(j)}$. Решим её методом Гаусса:

$$(A | E^{(j)}) \xrightarrow[\text{строк}]{\substack{\text{элементарные} \\ \text{преобразования}}} (E | B^{(j)}) \quad (6.59)$$

Поэтому

$$A \cdot X^{(j)} = E^{(j)} \Leftrightarrow E \cdot X^{(j)} = B^{(j)}, \quad \forall j = 1, \dots, n. \quad (6.60)$$

$$A \cdot X = E \Leftrightarrow E \cdot X = B \quad (6.61)$$

Единственное решение этого уравнения есть $X = B$, и поэтому $B = A^{-1}$. ■

A.6.11. Элементарные матрицы

Определение. Элементарная матрица — это матрица размера $n \times n$, получаемая из E с помощью одного элементарного преобразования строк или столбцов.

3 типа элементарных матриц.

1. Применяем ЭП I типа к E : прибавим к i -й строке j -ю строку, умноженную на число λ .

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix} \xrightarrow{\text{ЭП I}} U_{ij}(\lambda) = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & \dots & \dots & 0 \\ 0 & \dots & \dots & \dots & \dots & 0 \\ \dots & \dots & 1 & \lambda & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots & 1 & \dots & 0 \\ 0 & 0 & \dots & \dots & \dots & 1 \end{pmatrix} \leftarrow i\text{-я строка} \quad (6.62)$$

2. Применим к E элементарное преобразование II типа: переставим i -ю и j -ю строки.

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix} \xrightarrow{\text{ЭП II}} U_{ij} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & \dots & \dots & 0 \\ 0 & \dots & \dots & \dots & \dots & 0 \\ \dots & \dots & 0 & 1 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 0 & \dots & \dots & \dots & 1 \end{pmatrix} \leftarrow i\text{-я строка} \quad (6.63)$$

3. Применим к E элементарное преобразование III типа: умножим i -ю строку на число $\lambda \neq 0$.

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & \dots & 1 \end{pmatrix} \xrightarrow{\text{ЭП III}} U_i(\lambda) = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & \dots & 0 \\ 0 & \dots & \dots & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \lambda & \dots & 0 \\ 0 & 0 & \dots & \dots & 1 \end{pmatrix} \quad (6.64)$$

A.6.11.1. Основное свойство элементарных матриц

Пусть $A \in \text{Mat}_{m,n}$. Применим к A одно элементарное преобразование строк и получим A' , тогда

$$A' = U \cdot A, \quad (6.65)$$

где U — элементарная матрица, соответствующая применённому элементарному преобразованию строк.

Если же мы применим к A одно элементарное преобразование столбцов и получим A'' , то

$$A'' = A \cdot V, \quad (6.66)$$

где V — элементарная матрица, соответствующая применённому элементарному преобразованию столбцов.

Доказательство. \square Докажем последовательно утверждения про строки и про столбцы.

1. Для всех трёх типов элементарных преобразований, строки A'_i являются линейными комбинациями строк A_i с коэффициентами λ_{ik} .

$$A_i = \sum_{k=1}^m \lambda_{ik} A_k \quad (6.67)$$

Так как элементарное преобразование то же самое, то

$$U_i = \sum_{k=1}^m \lambda_{ik} E_k = (\lambda_{i1}, \dots, \lambda_{im}), \quad (6.68)$$

где $E_k = (0, \dots, 1_k, \dots, 0)$

$$a'_{ij} = \sum_{k=1}^m \lambda_{ik} a_{kj} = (\lambda_{i1}, \dots, \lambda_{im}) \cdot \begin{pmatrix} a_{1j} \\ \vdots \\ a_{mj} \end{pmatrix} = U_i \cdot A^{(j)} \quad (6.69)$$

Поэтому $A' = U \cdot A$.

2. Столбцы $A''^{(j)}$ выражаются через столбцы $A^{(j)}$.

$$A''^{(j)} = \sum_{k=1}^n \mu_{kj} A^{(k)} \quad (6.70)$$

$$V^{(j)} = \sum_{k=1}^n \mu_{kj} E^{(k)} = \begin{pmatrix} \mu_{1j} \\ \vdots \\ \mu_{nj} \end{pmatrix} \quad (6.71)$$

Поэтому

$$a''_{ij} = \sum_{k=1}^n \mu_{kj} a_{ik} = \begin{pmatrix} a_{i1} \\ \vdots \\ a_{in} \end{pmatrix} \cdot (\mu_{1j}, \dots, \mu_{nj}) = A_i \cdot V^{(j)} \quad (6.72)$$

Следовательно, $A'' = A \cdot V$. ■

Следствие. Элементарные матрицы обратимы, причём обратная матрица будет элементарной, полученной обратным элементарным преобразованием.

Доказательство. \square Пусть $E \rightarrow U$ – элементарная матрица, полученная преобразованиями строк. Тогда можно получить $U \rightarrow E$ обратным преобразованием. Но если применить это же обратное преобразование к E , то получим некоторую матрицу V .

$$U \leftrightarrow E \leftrightarrow V \quad (6.73)$$

Из основного свойства элементарных матриц:

$$E = V \cdot U \quad (6.74)$$

(получили матрицу E из матрицы U с помощью обратного элементарного преобразования V).

С другой стороны, можно получить E из матрицы V с помощью обратного к обратному ЭП, то есть умножением на U :

$$E = U \cdot V \quad (6.75)$$

Поэтому V обратна к U . Аналогично доказывается утверждение для столбцов. ■

A.6.11.2. Разложение невырожденной матрицы в произведение элементарных матриц

Теорема. Всякая невырожденная матрица раскладывается в произведение элементарных матриц.

Доказательство. \square Так как матрица A невырожденная, то с помощью элементарных преобразований строк можно привести её к единичной матрице E . По основному свойству элементарных матриц это означает, что существует последовательность элементарных матриц U_1, U_2, \dots, U_k , таких что

$$U_k \cdot U_{k-1} \cdot \dots \cdot U_1 \cdot A = E \quad (6.76)$$

где U_i получается с помощью i -го элементарного преобразования строк.

Так как для каждой из U_i существует обратная элементарная матрица U_i^{-1} , то умножив это равенство последовательно слева на обратные матрицы, получим

$$A = U_1^{-1} \cdot U_2^{-1} \cdot \dots \cdot U_k^{-1} \cdot E = U_1^{-1} \cdot U_2^{-1} \cdot \dots \cdot U_k^{-1} \quad (6.77)$$

Мы получили разложение A в произведение элементарных матриц, причём это матрицы тех преобразований, которые нужно получить, чтобы из единичной матрицы получить A . ■

A.7. Определители

Определение. Пусть задана квадратная матрица $A = \begin{pmatrix} a_{11} & \dots & a_{1n} \\ \vdots & \dots & \vdots \\ a_{n1} & \dots & a_{nn} \end{pmatrix}$. Её определитель это число, которое обозначают

$$\det A = \begin{vmatrix} a_{11} & \dots & a_{1n} \\ \vdots & \dots & \vdots \\ a_{n1} & \dots & a_{nn} \end{vmatrix} \quad (7.1)$$

По определению оно равно

$$\det A = \sum_{\sigma \in S_n} a_{1,\sigma(1)} \cdot a_{2,\sigma(2)} \cdot \dots \cdot a_{n,\sigma(n)} \cdot \operatorname{sgn}(\sigma) \quad (7.2)$$

Где сумма ведётся по всем перестановкам $\sigma \in S_n$.

A.7.1. Свойства определителя

Каждая квадратная $n \times n$ -матрица может рассматриваться как набор из n n -мерных векторов:

$$\det A = \det(A_1, A_2, \dots, A_n) \quad (7.3)$$

Определитель обладает свойствами:

1. Аддитивность:

$$\begin{aligned} \det(A_1, \dots, A'_k + A''_k, \dots, A_n) &= \det(A_1, \dots, A'_k, \dots, A_n) + \\ &+ \det(A_1, \dots, A''_k, \dots, A_n) \end{aligned} \quad (7.4)$$

Доказательство. \square Согласно определению определителя,

$$\det A = \sum_{(i_1, \dots, i_n)} a_{1,i_1} \cdot \dots \cdot a_{k,i_k} \cdot \dots \cdot a_{n,i_n} \cdot \operatorname{sgn}(i_1, \dots, i_n) \quad (7.5)$$

Но k -я строка распадается на сумму двух, поэтому $a_{k,i_k} = a'_{k,i_k} + a''_{k,i_k}$, рак- скрыв скобки, получим две суммы:

$$\begin{aligned} \det A &= \sum_{(i_1, \dots, i_n)} a_{1,i_1} \cdot \dots \cdot a'_{k,i_k} \cdot \dots \cdot a_{n,i_n} \cdot \operatorname{sgn}(i_1, \dots, i_n) + \\ &+ \sum_{(i_1, \dots, i_n)} a_{1,i_1} \cdot \dots \cdot a''_{k,i_k} \cdot \dots \cdot a_{n,i_n} \cdot \operatorname{sgn}(i_1, \dots, i_n) = \\ &= \det(A_1, \dots, A'_k, \dots, A_n) + \det(A_1, \dots, A''_k, \dots, A_n). \blacksquare \end{aligned} \quad (7.6)$$

2. Однородность:

$$\det(A_1, \dots, \lambda \cdot A_k, \dots, A_n) = \lambda \det(A_1, \dots, A_k, \dots, A_n) \quad (7.7)$$

Доказательство \square Левая часть равна:

$$\begin{aligned} & \sum_{(i_1, \dots, i_n)} a_{1,i_1} \cdot \dots \cdot (\lambda \cdot a_{k,i_k}) \cdot \dots \cdot a_{n,i_n} \cdot \operatorname{sgn}(i_1, \dots, i_n) = \\ & = \lambda \sum_{(i_1, \dots, i_n)} a_{1,i_1} \cdot \dots \cdot a_{k,i_k} \cdot \dots \cdot a_{n,i_n} \cdot \operatorname{sgn}(i_1, \dots, i_n) = \lambda \det A. \blacksquare \end{aligned} \quad (7.8)$$

3. Кососимметричность:

$$\det(A_1, \dots, A_k, \dots, A_l, \dots, A_n) = -\det(A_1, \dots, A_l, \dots, A_k, \dots, A_n) \quad (7.9)$$

Доказательство. \square Пусть матрица A' получена из матрицы A транспозицией двух строк с номерами k и l . Переставим в произведениях k -е и k -е элементы:

$$\begin{aligned} \det A &= \sum_{\sigma \in S_n} a_{1,\sigma(1)} \cdot \dots \cdot a_{k,\sigma(k)} \cdot \dots \cdot a_{l,\sigma(l)} \cdot \dots \cdot a_{n,\sigma(n)} \cdot \operatorname{sgn}(\sigma) = \\ &= \sum_{\sigma \in S_n} a_{1,\sigma(1)} \cdot \dots \cdot a_{l,\sigma(l)} \cdot \dots \cdot a_{k,\sigma(k)} \cdot \dots \cdot a_{n,\sigma(n)} \cdot \operatorname{sgn}(\sigma) \end{aligned} \quad (7.10)$$

Рассмотрим перестановку $\pi = \sigma \cdot \tau$, где $\tau = (k, l)$ — транспозиция k и l . Она действует на все номера, кроме k и l так же, как и σ , кроме того, $\pi \in S_n$, если $\sigma \in S_n$.

$$\det A = \sum_{\pi \in S_n} a'_{1,\pi(1)} \cdot \dots \cdot a'_{k,\pi(k)} \cdot \dots \cdot a'_{l,\pi(l)} \cdot \dots \cdot a'_{n,\pi(n)} \cdot \underbrace{\operatorname{sgn}(\sigma)}_{-\operatorname{sgn}(\pi)} = -\det A' \quad (7.11)$$

\blacksquare

4. Определитель матрицы с нулевой строкой равен нулю:

$$\exists k : A_k = 0 \Rightarrow \det A = 0. \quad (7.12)$$

Доказательство. \square

$$\begin{aligned} \det A &= \det(A_1, \dots, A_k, \dots, A_n) = \det(A_1, \dots, 0 \cdot A_k, \dots, A_n) = \\ &\stackrel{\text{св. 2}}{=} 0 \cdot \det(A_1, \dots, A_k, \dots, A_n) = 0. \blacksquare \end{aligned} \quad (7.13)$$

5. Если в определителе 2 строки совпадают, то определитель равен нулю:

$$\exists k \neq l : A_k = A_l \Rightarrow \det A = 0. \quad (7.14)$$

Доказательство. \square Переставим строки с местами k и l и воспользуемся косо-симметричностью:

$$\begin{aligned}\det A &= \det(A_1, \dots, A_k, \dots, A_l, \dots, A_n) = -\det(A_1, \dots, A_l, \dots, A_k, \dots, A_n) = \\ &= -\det A\end{aligned}\tag{7.15}$$

Но $\det A = -\det A \Rightarrow \det A = 0$. ■

6. Если в определителе две строки пропорциональны, то он равен нулю:

$$\exists k, l : k \neq l : A_l = \lambda \cdot A_k \Rightarrow \det A = 0\tag{7.16}$$

Доказательство. \square

$$\begin{aligned}\det(A_1, \dots, A_k, \dots, A_l, \dots, A_n) &= \det(A_1, \dots, A_k, \dots, \lambda \cdot A_k, \dots, A_n) = \\ &= \lambda \det(A_1, \dots, A_k, \dots, A_k, \dots, A_n) = 0.\end{aligned}\tag{7.17}$$

7. Элементарные преобразования строк I типа не меняют определитель матрицы.

Доказательство. \square Пусть матрица A' получена прибавлением l -й строки с коэффициентом λ к k -й строке матрицы A :

$$\begin{aligned}\det A' &= \det(A_1, \dots, A_k + \lambda \cdot A_l, \dots, A_l, \dots, A_n) = \\ &= \det(A_1, \dots, A_k, \dots, A_l, \dots, A_n) + \underbrace{\det(A_1, \dots, \lambda \cdot A_l, \dots, A_l, \dots, A_n)}_{=0 \text{ по свойству 6}} = \\ &= \det A.\end{aligned}\tag{7.18}$$

8. При транспонировании определитель матрицы не меняется:

$$\det A = \det A^T\tag{7.19}$$

Доказательство. \square Запишем по определению определитель транспонированной матрицы:

$$\det A^T = \sum_{\sigma \in S_n} a_{\sigma(1),1} \cdot \dots \cdot a_{\sigma(n),n} \operatorname{sgn}(\sigma).\tag{7.20}$$

Пусть $\pi = \sigma^{-1}$. Тогда $\sigma(j) = i \Rightarrow \pi(i) = j$. Если σ пробегает все перестановки S_n по одному разу, то и π пробегает все перестановки S_n по одному разу. Кроме того, $\operatorname{sgn}(\pi) = \operatorname{sgn}(\sigma)$.

$$\det A^T = \sum_{\pi \in S_n} a_{1,\pi(1)} \cdot \dots \cdot a_{n,\pi(n)} \cdot \underbrace{\operatorname{sgn}}_{\operatorname{sgn}(\pi)}(\sigma) = \det A.\blacksquare\tag{7.21}$$

9. Свойства 1-7 верны, если рассматривать определитель как функцию набора столбцов матрицы.

Из 1 и 2 свойства следует линейность определителя по любой строке, то есть определитель — полилинейная кососимметрическая функция строк матрицы. А из свойства 9 следует, что и от столбцов.

A.7.2. Вычисление определителя через приведение матрицы к треугольному виду

Мы можем привести элементарными преобразованиями строк любую квадратную матрицу A к ступенчатому виду, получив матрицу A^* , у которой ниже главной диагонали будут только нули:

$$A \xrightarrow[\text{ЭП строк}]{} A^* = \begin{pmatrix} \lambda_1 & \dots & \dots & \dots \\ 0 & \lambda_2 & \dots & \dots \\ \vdots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & \dots & \lambda_n \end{pmatrix} \quad (7.22)$$

Если по пути было сделано p перестановок строк и умножения строк производились на числа μ_1, \dots, μ_N , то определитель исходной матрицы так связан с определителем ступенчатой матрицы:

$$\det A = \det A^* \cdot (-1)^p \cdot \mu_1 \cdot \dots \cdot \mu_N \quad (7.23)$$

A.7.3. Определитель треугольной матрицы

Предложение. Определитель треугольной матрицы равен произведению элементов, стоящих на диагонали этой матрицы.

Доказательство. \square Пусть у нас есть треугольная квадратная матрица B с диагональю $(\lambda_1 \dots \lambda_n)$.

$$\det B = \begin{vmatrix} \lambda_1 & \dots & \dots & \dots \\ 0 & \lambda_2 & \dots & \dots \\ \vdots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & \dots & \lambda_n \end{vmatrix} \quad (7.24)$$

Применим элементарное преобразование I типа: обнулим все элементы в n -м столбце выше единицы.

$$\det B = \lambda_n \cdot \begin{vmatrix} \lambda_1 & \dots & \dots & 0 \\ 0 & \lambda_2 & \dots & 0 \\ \vdots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & \dots & 1 \end{vmatrix} \quad (7.25)$$

Теперь вынесем множитель λ_{n-1} из предпоследней строки.

$$\det B = \lambda_n \cdot \lambda_{n-1} \begin{vmatrix} \lambda_1 & \dots & \dots & 0 \\ 0 & \lambda_2 & \dots & \dots \\ \vdots & \dots & 1 & 0 \\ 0 & 0 & \dots & 1 \end{vmatrix} \quad (7.26)$$

Теперь с помощью элементарных преобразований I типа обнулим все элементы $(n-1)$ -го столбца выше единицы. Повторим эту процедуру до тех пор, пока на главной диагонали не останутся только единицы. Полученная матрица есть единичная.

$$\det B = \lambda_1 \cdot \dots \cdot \lambda_n \cdot \begin{vmatrix} 1 & \dots & \dots & 0 \\ \vdots & 1 & \dots & 0 \\ \vdots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & \dots & \dots & 1 \end{vmatrix} \quad (7.27)$$

Но в разложении определителя единичной матрицы только одно ненулевое произведение: $1 \cdot 1 \cdot \dots \cdot 1 = 1$. Поэтому $\det B = \lambda_1 \cdot \dots \cdot \lambda_n$. ■

A.7.4. Определитель и другие кососимметричные полилинейные функции строк

Мы установили, что

$$\det A = (-1)^p \cdot \mu_1 \cdot \dots \cdot \mu_N \cdot \lambda_1 \cdot \dots \cdot \lambda_n \quad (7.28)$$

где p — количество перестановок строк, а μ_1, \dots, μ_N — множители, на которые умножались строки.

Если $f(A)$ — любая кососимметричная полилинейная функция строк матрицы A , то аналогичными выкладками для неё можно получить

$$f(A) = (-1)^p \cdot \mu_1 \cdot \dots \cdot \mu_N \cdot \lambda_1 \cdot \dots \cdot \lambda_n \cdot f(E) \quad (7.29)$$

Поэтому функция f отличается от \det лишь постоянным множителем.

$$f(A) = f(E) \cdot \det A \quad (7.30)$$

A.7.5. Разбиение матрицы на 4 блока

 *Предложение.* Пусть матрицу A можно разбить на 4 блока:

$$A = \begin{pmatrix} B & D \\ O & C \end{pmatrix} \quad (7.31)$$

причём $B \in \text{Mat}_k$, $C \in \text{Mat}_{n-k}$, $D \in \text{Mat}_{k,n-k}$, O — нулевая матрица. Тогда

$$\det A = \det B \cdot \det C \quad (7.32)$$

Доказательство. \square

- Пусть матрица A — треугольная, $\Rightarrow B, C$ — тоже. Если $\text{diag } B = (\beta_1, \dots, \beta_k)$ и $\text{diag } C = (\gamma_1, \dots, \gamma_{n-k})$, то

$$\det A = \beta_1 \cdot \dots \cdot \beta_k \cdot \gamma_1 \cdot \dots \cdot \gamma_{n-k} = \det B \cdot \det C \quad (7.33)$$

- В общем случае, мы можем привести A к треугольному виду. Путём элементарных преобразований первых k строк, так, чтобы B' стала ступенчатой.

$$A \xrightarrow[\substack{\text{ЭП } k \\ \text{строк}}]{} A' = \begin{pmatrix} B' & D' \\ O & C \end{pmatrix} \xrightarrow[\substack{(n-k) \\ \text{строк}}]{} A'' = \begin{pmatrix} B' & D' \\ O & C' \end{pmatrix} \quad (7.34)$$

При преобразованиях первых k строк имеем

$$\det A = \det A' \cdot (-1)^p \cdot \frac{1}{\mu_1} \cdot \dots \cdot \frac{1}{\mu_q} \quad (7.35)$$

Если r — количество ЭП2, а ν_i — множители ЭП3, то

$$\det A' = \det A'' \cdot (-1)^r \cdot \frac{1}{\nu_1} \cdot \dots \cdot \frac{1}{\nu_s} \quad (7.36)$$

Итак, соберём $\det A$:

$$\det A = \det A'' \cdot (-1)^{p+r} \cdot \frac{1}{\mu_1 \cdot \dots \cdot \mu_q \cdot \nu_1 \cdot \dots \cdot \nu_s} \quad (7.37)$$

Но матрица A'' треугольная, поэтому по доказанному в случае 1, имеем

$$\det A = \det B' \cdot (-1)^p \cdot \frac{1}{\mu_1 \cdot \dots \cdot \mu_q} \cdot \det C' \cdot (-1)^r \cdot \frac{1}{\nu_1 \cdot \dots \cdot \nu_s} = \det B \cdot \det C \quad (7.38)$$

■

A.7.6. Определитель Вандермонда

Определение. Определителем Вандермонда называется определитель матрицы

$$V(x_1, \dots, x_n) = \begin{vmatrix} 1 & 1 & \dots & 1 \\ x_1 & x_2 & \dots & x_n \\ x_1^2 & x_2^2 & \dots & x_n^2 \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ x_1^{n-1} & x_2^{n-1} & \dots & x_n^{n-1} \end{vmatrix} \quad (7.39)$$

A.7.6.1. Вычисление определителя Вандермонда

Обнулим в первом столбце $V(x_1, \dots, x_n)$ все элементы, кроме первого, вычитая из каждой строки предыдущую, умноженную на соответствующую степень x_1 .

$$V(x_1, \dots, x_n) = \begin{vmatrix} 1 & 1 & \dots & 1 \\ 0 & x_2 - x_1 & \dots & x_n - x_1 \\ 0 & x_2^2 - x_1 \cdot x_2 & \dots & x_n^2 - x_1 \cdot x_n \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & x_2^{n-1} - x_1 \cdot x_2^{n-2} & \dots & x_n^{n-1} - x_1 \cdot x_n^{n-2} \end{vmatrix} \quad (7.40)$$

Теперь, согласно предложению, мы можем разбить определитель на два блока, вынести множители по однородности определителя и получить рекурренту.

$$\begin{aligned} V(x_1, \dots, x_n) &= 1 \cdot \begin{vmatrix} x_2 - x_1 & x_3 - x_1 & \dots & x_n - x_1 \\ x_2^2 - x_1 \cdot x_2 & x_3^2 - x_1 \cdot x_3 & \dots & x_n^2 - x_1 \cdot x_n \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ x_2^{n-1} - x_1 \cdot x_2^{n-2} & x_3^{n-1} - x_1 \cdot x_3^{n-2} & \dots & x_n^{n-1} - x_1 \cdot x_n^{n-2} \end{vmatrix} = \\ &= (x_2 - x_1) \cdot \dots \cdot (x_n - x_1) \cdot \begin{vmatrix} 1 & 1 & \dots & 1 \\ x_2 & x_3 & \dots & x_n \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ x_2^{n-1} & x_3^{n-1} & \dots & x_n^{n-1} \end{vmatrix} = \\ &= (x_2 - x_1) \cdot \dots \cdot (x_n - x_1) \cdot V(x_2, \dots, x_n) \end{aligned} \quad (7.41)$$

Рассуждая по индукции, будем иметь

$$V(x_1, \dots, x_n) = (x_2 - x_1) \cdot \dots \cdot (x_n - x_{n-2}) \cdot \begin{vmatrix} 1 & 1 \\ x_{n-1} & x_n \end{vmatrix} \quad (7.42)$$

Итак,

$$V(x_1, \dots, x_n) = \prod_{1 \leq j < i \leq n} (x_i - x_j) \quad (7.43)$$

A.7.6.2. Основное свойство определителя Вандермонда

В качестве следствия сразу получаем, что

 **Основное свойство определителя Вандермонда.** Определитель Вандермонда равен нулю тогда и только тогда, когда среди чисел x_1, \dots, x_n есть равные.

$$V(x_1, \dots, x_n) = 0 \Leftrightarrow \exists i \neq j : x_i = x_j \quad (7.44)$$

A.7.7. Критерий невырожденности матрицы

 **Теорема.** Квадратная матрица A невырождена тогда и только тогда, когда $\det A \neq 0$.

Доказательство. \square Пусть $A \in \text{Mat}_n$. Приведём матрицу A с помощью ЭП строк к треугольному виду, получив A^* . Так как ранг не меняется, то матрица A невырождена \Leftrightarrow матрица A^* невырождена, то есть $\text{rk } A^* = n$. А это случается если и только если в $\text{diag } A^* = (\lambda_1, \dots, \lambda_n)$ все λ_i отличны от нуля. Но так как $\det A^* = \lambda_1 \cdot \dots \cdot \lambda_n$, то $\det A \neq 0$, так как эти два определителя пропорциональны. ■

A.7.8. Мультипликативное свойство определителя

 **Теорема.** Пусть $A, B \in \text{Mat}_n$. Тогда

$$\det(A \cdot B) = \det(A) \cdot \det(B) \quad (7.45)$$

Доказательство. \square Рассмотрим два случая

1. Если A вырождена. Тогда $A \cdot B$ тоже вырождена, так как $\text{rk}(A \cdot B) \leq \text{rk } A < n$. Аналогично, если B вырождена.
2. Пусть обе матрицы невырождены. Каждую невырожденную матрицу можно представить в виде произведения элементарных матриц

$$A = U_1 \cdot \dots \cdot U_N \quad (7.46)$$

Тогда можно сказать, что $E \rightarrow A$ в ходе N элементарных преобразований строк. Следовательно

$$A \cdot B = U_1 \cdot \dots \cdot U_N \cdot B \quad (7.47)$$

Значит матрица $A \cdot B$ получена с помощью *тех же* ЭП строк из матрицы B .

Тогда

$$\det A = \lambda \cdot \det E = \lambda \quad (7.48)$$

где λ – коэффициент, получаемый при этих преобразованиях. Значит $\det(A \cdot B) = \lambda \cdot \det B = \det A \cdot \det B$. ■

A.7.9. Миноры и вычисление определителей

Определение. Выделим в матрице $A \in \text{Mat}_{m,n}$ квадратную подматрицу $k \times k$ в строках с номерами i_1, \dots, i_k и столбцах с номерами j_1, \dots, j_k .

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & \dots & \dots & \dots & a_{1n} \\ \vdots & \dots & \dots & \dots & \vdots \\ \vdots & \circ & \circ & \circ & \vdots \\ \vdots & \circ & \circ & \circ & \vdots \\ \vdots & \circ & \circ & \circ & \vdots \\ a_{m1} & \dots & \dots & \dots & a_{mn} \end{pmatrix} \quad (7.49)$$

Определитель выделенной подматрицы называется минором порядка k матрицы A .

$$M_{i_1, \dots, i_k}^{j_1, \dots, j_k} = \begin{vmatrix} a_{i_1, j_1} & \dots & a_{i_1, j_k} \\ \dots & \dots & \dots \\ a_{i_k, j_1} & \dots & a_{i_k, j_k} \end{vmatrix} \quad (7.50)$$

В частности, если $m = n$, рассмотрим миноры порядка $n - 1$.

Определение. Дополнительным минором к элементу a_{ij} называется определитель матрицы, полученной вычёркиванием i -й строки и j -го столбца матрицы A . Обозначается M_{ij} .

Определение. Алгебраическим дополнением к элементу a_{ij} матрицы A называется число

$$A_{ij} = (-1)^{i+j} M_{ij} \quad (7.51)$$

 *Теорема.* Определитель матрицы A равен сумме произведений элементов любой строки (столбца) на соответствующие алгебраические дополнения.

$$\det A = a_{i1} \cdot A_{i1} + \dots + a_{in} \cdot A_{in} \quad (7.52)$$

$$\det A = a_{1j} \cdot A_{1j} + \dots + a_{nj} \cdot A_{nj} \quad (7.53)$$

Доказательство. \square Докажем разложение по столбцу.

$$A^{(j)} = \begin{pmatrix} a_{1j} \\ 0 \\ \vdots \\ 0 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 0 \\ a_{2j} \\ \vdots \\ 0 \end{pmatrix} + \dots + \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ \dots \\ a_{nj} \end{pmatrix} \quad (7.54)$$

По аддитивности определителя имеем:

$$\begin{aligned}
\det A &= \sum_{i=1}^n \begin{vmatrix} a_{11} & \dots & a_{1,(j-1)} & 0 & a_{1,(j+1)} & \dots & a_{1n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{i1} & \dots & a_{i,(j-1)} & a_{ij} & a_{i,(j+1)} & \dots & a_{in} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{n1} & \dots & a_{n,(j-1)} & 0 & a_{n,(j+1)} & \dots & a_{nn} \end{vmatrix} = \\
&= \sum_{i=1}^n (-1)^{j-1} \cdot \begin{vmatrix} 0 & a_{11} & \dots & a_{1,(j-1)} & a_{1,(j+1)} & \dots & a_{1n} \\ a_{ij} & a_{i1} & \dots & a_{i,(j-1)} & a_{i,(j+1)} & \dots & a_{in} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & a_{n1} & \dots & a_{n,(j-1)} & a_{n,(j+1)} & \dots & a_{nn} \end{vmatrix} = \tag{7.55} \\
&= \sum_{i=1}^n (-1)^{i+j-2} \cdot \begin{vmatrix} a_{ij} & a_{i1} & \dots & a_{i,j-1} & a_{i,j+1} & \dots & a_{in} \\ 0 & a_{11} & \dots & a_{1,j-1} & a_{1,j+1} & \dots & a_{1n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & a_{n1} & \dots & a_{n,(j-1)} & a_{n,(j+1)} & \dots & a_{nn} \end{vmatrix} = \sum_{i=1}^n (-1)^{i+j} \cdot a_{ij} \cdot M_{ij}
\end{aligned}$$

Итак, для разложения по столбцам:

$$\det A = \sum_{i=1}^n a_{ij} \cdot A_{ij} \tag{7.56}$$

Чтобы получить разложение по строкам, достаточно заметить, что

$$\det A = \det A^T = \sum_{j=1}^n a_{ji}^T \cdot A_{ji}^T = \sum_{i=1}^n a_{ij} \cdot A_{ij} \blacksquare \tag{7.57}$$

A.7.10. Лемма о фальшивом разложении определителя

 Пусть $i \neq j$, тогда

$$a_{i1} \cdot A_{j1} + \dots + a_{in} \cdot A_{jn} = 0 \tag{7.58}$$

$$a_{1i} \cdot A_{1j} + \dots + a_{ni} \cdot A_{nj} = 0 \tag{7.59}$$

Доказательство. Рассмотрим матрицу, где вместо j строки будет i -я строка той же матрицы A .

$$\det A' = \begin{vmatrix} a_{11} & \dots & a_{1n} \\ \dots & \dots & \dots \\ a_{i1} & \dots & a_{in} \\ \dots & \dots & \dots \\ a_{i1} & \dots & a_{in} \\ \dots & \dots & \dots \\ a_{n1} & \dots & a_{nn} \end{vmatrix} = 0 \tag{7.60}$$

Но если разложить его по j -й строке, то получим сумму:

$$\det A' = a_{i1} \cdot A_{j1} + \dots + a_{in} \cdot A_{jn} = 0 \quad (7.61)$$

Аналогично доказывается для столбцов. ■

A.7.11. Формула обратной матрицы

Определение. Назовём присоединённой матрицей к квадратной матрице A , обозначаемой A^\vee называется транспонированная матрица алгебраических дополнений матрицы A .

$$A^\vee = \begin{pmatrix} A_{11} & A_{21} & \dots & A_{n1} \\ A_{12} & A_{22} & \dots & A_{n2} \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ A_{1n} & A_{2n} & \dots & A_{nn} \end{pmatrix} \quad (7.62)$$

Элементы $a_{ij}^\vee = A_{ji}$.

 **Теорема.** Пусть матрица A обратима. Тогда обратная матрица может быть вычислена по формуле

$$A^{-1} = \frac{1}{\det A} \cdot A^\vee \quad (7.63)$$

Доказательство. □ Рассмотрим $A \cdot A^\vee$: её элемент на месте (i, j) равен

$$a_{i1}a_{1j}^\vee + a_{i2}a_{2j}^\vee + \dots + a_{in}a_{nj}^\vee = a_{i1} \cdot A_{j1} + a_{i2} \cdot A_{j2} + \dots + a_{in} \cdot A_{jn} \quad (7.64)$$

Если $i = j$, то эта сумма равна $\det A$, а при $i \neq j$, по лемме о фальшивом разложении определителя, она равна нулю. Поэтому

$$A \cdot A^\vee = \begin{pmatrix} \det A & 0 & \dots & 0 \\ 0 & \det A & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & \dots & \det A \end{pmatrix} = \det A \cdot E \quad (7.65)$$

Аналогично, в порядке $A^\vee \cdot A$ для элемента на позиции (i, j) имеем

$$a_{11}^\vee \cdot a_{1j} + a_{12}^\vee \cdot a_{2j} + \dots + a_{in}^\vee \cdot a_{nj} = A_{1i} \cdot a_{1j} + A_{2i} \cdot a_{2j} + \dots + A_{ni} \cdot a_{nj} \quad (7.66)$$

При $i = j$ это разложение $\det A$ по столбцу i , а если $i \neq j$, по лемме о фальшивом разложении определителя, сумма равна нулю. Следовательно,

$$A^\vee \cdot A = \det A \cdot E \quad (7.67)$$

Если матрица A обратима, то $\det A \neq 0$, и мы получаем, что

$$A \cdot \left(\frac{1}{\det A} \cdot A^\vee \right) = \left(\frac{1}{\det A} \cdot A \right) \cdot A^\vee = E \quad (7.68)$$

что и означает требуемое. ■

A.7.12. Метод Крамера решения СЛУ

Пусть у нас есть квадратная СЛУ

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + \dots + a_{1n}x_n = b_1 \\ \vdots \\ a_{n1}x_1 + \dots + a_{nn}x_n = b_n \end{cases} \quad (7.69)$$

Её матричная запись будет

$$A \cdot x = b, \quad (7.70)$$

$$\text{где } A = \begin{pmatrix} a_{11} & \dots & a_{1n} \\ \dots & \dots & \dots \\ a_{n1} & \dots & a_{nn} \end{pmatrix}, x = \begin{pmatrix} x_1 \\ \dots \\ x_n \end{pmatrix}, b = \begin{pmatrix} b_1 \\ \dots \\ b_n \end{pmatrix}.$$

Обозначим $\Delta = \det A$. Обозначим Δ_j определитель матрицы, которая получается заменой j -го столбца в матрице коэффициентов на столбец свободных членов ($j = 1, \dots, n$).

$$\Delta = \begin{vmatrix} a_{11} & \dots & a_{1n} \\ \dots & \dots & \dots \\ a_{n1} & \dots & a_{nn} \end{vmatrix} \quad (7.71)$$

$$\Delta_j = \begin{vmatrix} a_{11} & \dots & a_{1(j-1)} & b_1 & a_{1(j+1)} & \dots & a_{1n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ a_{n1} & \dots & a_{n,(j-1)} & b_n & a_{n,(j+1)} & \dots & a_{nn} \end{vmatrix} \quad (7.72)$$

Правило Крамера.

- Квадратная СЛУ определена в том и только в том случае, когда $\det A \neq 0$, причём

$$x_j = \frac{\Delta_j}{\Delta} \quad (7.73)$$

- Если $\Delta = 0$, но $\exists j : \Delta_j \neq 0$, то СЛУ несовместна.

Доказательство. □ Заметим, что A это матрица $n \times n$, тогда как $\tilde{A} = A \mid b$ это матрица $n \times (n + 1)$. Тогда

$$\operatorname{rk} A \leq \operatorname{rk} \tilde{A} \leq n \quad (7.74)$$

- Критерий определённости. Система линейных уравнений определена тогда и только тогда, когда $\text{rk } A = \text{rk } \tilde{A} = n \Leftrightarrow \text{rk } A = n$ (последняя равносильность следует из неравенства выше). Значит это равносильно тому, что A невырождена, что эквивалентно $\Delta \neq 0$.
- Условие несовместности. Пусть $\Delta = 0$, но $\exists j : \Delta_j \neq 0$. Отсюда следует, что столбцы матрицы j линейно независимы.

$$\text{rk}\{A^{(1)}, \dots, A^{(j-1)}, b, A^{(j+1)}, \dots, A^{(n)}\} = n \quad (7.75)$$

При добавлении ещё одной строки ранг может только увеличиться:

$$\text{rk}\{A^{(1)}, \dots, A^{(j-1)}, b, A^{(j+1)}, \dots, A^{(n)}\} \leq \text{rk } \tilde{A} \quad (7.76)$$

Значит $\text{rk } \tilde{A} = n$ и $\text{rk } A < n$, поэтому, по теореме Кронекера-Капелли, система несовместна.

- Доказательство формул Крамера. Предположим, что $\Delta \neq 0$. Значит у матрицы коэффициентов есть обратная: $A^{-1} = \frac{1}{\det A} \cdot A^\vee$. Если $A \cdot x = b$, то

$$x = A^{-1} \cdot b = \frac{1}{\det A} \cdot A^\vee \cdot b \quad (7.77)$$

Распишем каждое неизвестное, $\forall j = 1, \dots, n$:

$$x_j = \frac{a_{j1}^\vee \cdot b_1 + a_{j2}^\vee \cdot b_2 + \dots + a_{jn}^\vee \cdot b_n}{\det A} = \frac{b_1 \cdot A_{1j} + b_2 \cdot A_{2j} + \dots + b_n \cdot A_{nj}}{\det A} \stackrel{(7.78)}{=} \frac{\Delta_j}{\Delta}$$

■

A.7.13. Теорема о ранге матрицы

 **Теорема.** Ранг произвольной матрицы равен наибольшему порядку её ненулевого минора.

Доказательство. □ Пусть r — наибольший порядок ненулевого минора $M_{i_1, \dots, i_r}^{j_1, \dots, j_r} \neq 0$ матрицы A . Переставим строки и столбцы в матрице A . От этого миноры могут лишь поменять знак, но не равенство или неравенство нулю. А именно переставим так, чтобы $M_{1, \dots, r}^{1, \dots, r} \neq 0$, — минор занимал первые r строк и r столбцов. Тогда $M_{1, \dots, r}^{1, \dots, r} = \det \overline{A} \neq 0$. Пусть

$$\overline{A}_i = (a_{i1}, \dots, a_{ir}) \quad (7.79)$$

Матрица \overline{A} невырождена \Rightarrow её строки линейно независимы, значит $\{\overline{A}_1, \dots, \overline{A}_r\}$ образуют базис в $\mathbb{R}^n \Rightarrow \forall i > r \ \exists! (\lambda_1, \dots, \lambda_r) :$

$$\overline{A}_i = \lambda_1 \overline{A}_1 + \dots + \lambda_r \overline{A}_r \quad (7.80)$$

Так как $\{\overline{A}_1, \dots, \overline{A}_r\}$ линейно независимы, то линейно независимы и строки $\{\overline{A}_1, \dots, \overline{A}_r\}$. Если бы это было не так, то $\exists \mu_1, \dots, \mu_r \neq 0$:

$$\mu_1 \overline{A}_1 + \dots + \mu_r \overline{A}_r = 0 \quad (7.81)$$

что неверно.

$\forall i, j > r$ Рассмотрим $M_{1, \dots, r, i}^{1, \dots, r, j}$ — он называется окаймляющим минором, и он обязательно равен нулю. Рассмотрим соответствующую матрицу $\overline{\overline{A}}$. Её строки линейно независимы, а $\{\overline{\overline{A}}_1, \dots, \overline{\overline{A}}_{r+1}\}$ уже линейно зависимы.

$$\overline{\overline{A}}_{r+1} = \lambda'_1 \overline{\overline{A}}_1 + \dots + \lambda'_{r+1} \overline{\overline{A}}_r \quad (7.82)$$

Поэтому для более коротких строк верно

$$\overline{A}_{r+1} = \lambda'_1 \overline{A}_1 + \dots + \lambda'_{r+1} \overline{A}_r \quad (7.83)$$

В силу единственности выражения строки в базисе,

$$\lambda'_1 = \lambda_1, \dots, \lambda'_{r+1} = \lambda_r \quad (7.84)$$

Следовательно $\forall i = 1, \dots, n$:

$$a_{ij} = \lambda_1 a_{1j} + \dots + \lambda_r a_{rj} \Rightarrow A_i = \lambda_1 A_1 + \dots + \lambda_r A_r \quad (7.85)$$

И поэтому $\{A_1, \dots, A_r\}$ образует базис системы строк матрицы A , поэтому ранг матрицы A равен r . ■

A.8. Группы, кольца, поля

Определение. Группа — это множество G , на котором задана бинарная операция $(*)$, т. е. отображение $G \times G \rightarrow G$, которое удовлетворяет следующим свойствам(аксиомы группы):

1. Ассоциативность: $\forall a, b, c \in G : (a * b) * c = a * (b * c)$.
2. Существование нейтрального элемента: $\exists e \in G : \forall g \in G : e * g = g * e = g$.
3. Существование обратного элемента: $\forall g \in G : \exists h \in G : g * h = h * g = e$.

A.8.1. Следствия из аксиом группы

1. Единственность нейтрального элемента: $\forall g \in G \exists! e \in G : e * g = g * e = g$.

Доказательство. \square Предположим, что есть два нейтральных элемента: e и e' .

Тогда так как e — нейтральный элемент,

$$e' * e = e \quad (8.1)$$

Аналогично, в силу нейтральности элемента e' ,

$$e' * e = e' \quad (8.2)$$

Поэтому $e \equiv e'$. ■

2. Единственность обратного элемента: $\forall g \in G \exists! h \in G : g * h = h * g = e$. *Доказательство.* \square Предположим, что для некоторого элемента g существуют два обратных элемента: h и h' . Тогда

$$h' * g * h = (h' * g) * h = e * h = h \quad (8.3)$$

Но в силу ассоциативности, скобки можно расставить иначе:

$$h' * g * h = h' * (g * h) = h' * e = h' \quad (8.4)$$

Поэтому $h \equiv h'$. ■

2.1. Поэтому обозначим обратный элемент к g как g^{-1} .

A.8.1.1. Абелевы группы

Определение. Группа G называется коммутативной(абелевой), если

$$\forall a, b \in G : a * b = b * a. \quad (8.5)$$

A.8.2. Примеры групп и не группы

1. \mathbb{N} с умножением чисел — не группа, так как нарушена аксиома 3.
2. Множество перестановок S_n с операцией умножения(композиции) — это группа.
 - Называется симметрической группой степени n .

3. Арифметическое векторное пространство \mathbb{R}^n с операцией $+$. Это абелева группа.

A.8.3. Подгруппа

Определение. Пусть G – группа. Множество $H \subseteq G$ называется подгруппой группы G , если

1. $H \neq \emptyset$
2. $a, b \in H \Rightarrow a * b \in H$
3. $a \in H \Rightarrow a^{-1} \in H$.

Замечания

1. В любой подгруппе есть нейтральный элемент.

Доказательство. \square Пусть H – подгруппа G , по свойству 1 из определения подгруппы $H \neq \emptyset$, значит существует элемент $h \in H$. По свойству 3 определения, $h^{-1} \in H$. Следовательно, по свойству 2, $h * h^{-1} = e \in H$. ■

2. Подгруппа H сама является группой относительно операции на самой группе G , ограниченной на H .

Например,

1. Множество чётных перестановок $A_n \subset S_n$. Это подгруппа S_n .
 - A_n называется знаком переменной группой степени n .
2. $S_n \setminus A_n$ не является подгруппой S_n , так как произведение двух нечётных перестановок является чётной перестановкой.

A.8.4. Кольца

[А что такое кольцо?](#)

Определение. Кольцо – это множество K с двумя бинарными операциями – сложения и умножения, которое удовлетворяет следующим аксиомам:

1. Коммутативность сложения: $\forall a, b \in K : a + b = b + a$.
2. Ассоциативность сложения: $\forall a, b, c \in K : (a + b) + c = a + (b + c)$.
3. Нулевой элемент: $\exists 0 \in K : \forall a \in K : a + 0 = a$.
4. Существование противоположного элемента: $\forall a \in K : \exists (-a) \in K : a + (-a) = 0$.

Говоря коротко, $(K, +)$ – абелева группа. Такая группа называется аддитивной группой кольца K .

5. Дистрибутивность умножения относительно сложения.

5.1. Левая дистрибутивность, $\forall a, b, c \in K$:

$$a \cdot (b + c) = a \cdot b + a \cdot c \quad (8.6)$$

5.2. Правая дистрибутивность, $\forall a, b, c \in K$:

$$(a + b) \cdot c = a \cdot c + b \cdot c \quad (8.7)$$

A.8.4.1. Классы колец

1. Коммутативные: $\forall a, b \in K : a \cdot b = b \cdot a$.
2. Ассоциативные: $\forall a, b, c \in K : (a \cdot b) \cdot c = a \cdot (b \cdot c)$.
3. С единицей: $\exists 1 \in K : \forall a \in K : a \cdot 1 = 1 \cdot a = a$.
4. И другие.

A.8.4.2. Примеры колец

1. $(\mathbb{Z}, +, \cdot)$ — коммутативное ассоциативное кольцо с единицей
2. $(\text{Mat}_n, +, \cdot)$ — некоммутативное ассоциативное кольцо с единицей.
3. $\{\text{геометрические векторы в пространстве}\}$ с операцией сложения и векторного произведения — некоммутативное неассоциативное кольцо без единицы.

A.8.5. Следствия из аксиом кольца

Пусть K — кольцо с единицей. Первые два свойства следуют из теории групп, так как $(K, +)$ — абелева группа.

1. Единственность нулевого элемента.
2. Единственность противоположного элемента.
3. Единственность 1.
4. $0 \cdot a = a \cdot 0 = 0, \forall a \in K$.

Доказательство. \square Пусть $a \in K$. Тогда

$$0 \cdot a = (0 + 0) \cdot a = 0 \cdot a + 0 \cdot a \quad (8.8)$$

Добавим $-(0 \cdot a)$ к обеим частям равенства:

$$0 = 0 \cdot a \quad (8.9)$$

Что и требовалось(аналогично с нулевым элементом справа). \square

5. $(-1) \cdot a = a \cdot (-1) = -a, \forall a \in K$. *Доказательство.* \square

$$a + (-1) \cdot a = 1 \cdot a + (-1) \cdot a = (1 + (-1)) \cdot a = 0 \cdot a = 0 \quad (8.10)$$

Аналогично с умножением справа. ■

Далее кольца будем предполагать ассоциативными и с единицей.

A.8.6. Обратный элемент в кольце

Определение. Пусть K – ассоциативное кольцо с единицей. Назовём элемент $a \in K$ обратимым, если $\exists b \in K : a \cdot b = b \cdot a = 1$.

Обозначение: a^{-1} .

Не у каждого элемента в кольце есть обратный, то если он есть, то он единственный.

Замечание. Если $|K| > 1$, то 0 не обратим.

Доказательство. □ Пусть $|K| > 1$.

1. Во-первых, $1 \neq 0$. Если бы это было не так, то $\forall a \in K : a = a \cdot 1 = a \cdot 0 = 0$.
2. $\forall b \in K : 0 \cdot b = b \cdot 0 = 0 \neq 1$.

На что бы мы не умножили 0, результат всегда будет 0, а не 1. Следовательно, 0 не может иметь обратного элемента. ■

Предложение. Положим $K^\times = \{a \mid a \text{ обратим}\}$

1. $a, b \in K \Rightarrow a \cdot b \in K$
2. K^\times с операцией умножения – группа, называемая мультиликативной группой кольца K .

Доказательство. □

1. Докажем, что $(a \cdot b)^{-1} = b^{-1} \cdot a^{-1}$. Действительно,

$$(a \cdot b) \cdot (b \cdot a)^{-1} = a \cdot (b \cdot b^{-1}) \cdot a^{-1} = a \cdot 1 \cdot a^{-1} = a \cdot a^{-1} = 1. \quad (8.11)$$

Итак, произведение двух обратимых элементов обратимо.

2. $1 \in K$, кроме того, $a, b \in K^\times \Rightarrow a \cdot b \in K^\times$ и, наконец, $(a^{-1})^{-1} = a$.

Исходя из этих свойств K^\times – группа относительно умножения. ■

Например,

1. $\mathbb{Z}^\times = \{-1, +1\}$
2. $\text{Mat}_n^\times = \{A \mid \text{rk}(A) = n\} = \{A \mid \det A \neq 0\} = GL_n$ – так называется *полная матричная группа*.

A.8.7. Делители нуля

Определение. Элемент $a \in K$, $a \neq 0$ называется левым делителем нуля, если $\exists b \in K$ и $b \neq 0$: $a \cdot b = 0$.

Определение. Элемент $a \in K$, $a \neq 0$ называется правым делителем нуля, если $\exists b \in K$ и $b \neq 0$: $b \cdot a = 0$.

Примеры:

1. В \mathbb{Z} нет делителей нуля!

2. В Mat_n есть делители нуля: $A = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 0 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$ и $B = \begin{pmatrix} 0 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & \dots & 0 \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$, для которых $A \cdot B = 0$.

Предложение.

1. Делители нуля необратимы.

2. Если $a, b, c \in K$, причём $a \neq 0$ и a не является левым делителем нуля, то

$$a \cdot b = a \cdot c \Rightarrow b = c. \quad (8.12)$$

3. Если $a, b, c \in K$, причём $a \neq 0$ и a не является правым делителем нуля, то

$$b \cdot a = c \cdot a \Rightarrow b = c. \quad (8.13)$$

Доказательство. \square Пусть a обратим и $a \cdot b = 0$. Умножим это равенство слева на a^{-1} :

$$a^{-1} \cdot a \cdot b = a^{-1} \cdot 0 \quad (8.14)$$

Отсюда $b = 0$. Аналогично можно доказать, что $b \cdot a = 0 \Rightarrow b = 0$. Поэтому делители нуля необратимы.

Теперь предположим что $a \cdot b = a \cdot c$. Прибавим к левой и правой части $-(a \cdot c)$:

$$a \cdot b - a \cdot c = 0 \quad (8.15)$$

$$a \cdot (b - c) = 0 \quad (8.16)$$

Но a не является делителем нуля слева, следовательно, $b - c = 0$, то есть $b = c$.

Аналогично доказывается пункт 3. ■

A.8.8. Поля

Определение. Поле – это коммутативное, ассоциативное кольцо K с единицей, в котором $|K| > 1$ и все ненулевые элементы обратимы.

Например,

1. \mathbb{Z} – не поле.

2. \mathbb{R} – поле.

Определение. Пусть K – кольцо или поле. Подмножество $L \subseteq K$ называется подкольцом или подполем, если

1. $L \neq \emptyset$
2. $a, b \in L \Rightarrow a + b \in L, a \cdot b \in L.$
3. $a \in L \Rightarrow (-a) \in L.$
 - в частности, $0 \in L.$
4. Для полей дополнительно требуется $|L| > 1.$

5. Для полей дополнительно требуется $a \in L, a \neq 0 \Rightarrow a^{-1} \in L.$
 - В частности, $1 \in L.$

Подкольцо/подполе само является кольцом/полем относительно операций, ограниченном на этом подкольце/подполе.

Например,

$$\begin{array}{c} \mathbb{Z} \\ \text{подкольцо} \end{array} \subset \begin{array}{c} \mathbb{Q} \\ \text{подполе} \end{array} \subset \begin{array}{c} \mathbb{R} \\ \text{поле} \end{array} \quad (8.17)$$

В теории СЛАУ, матриц, определителей для чисел кроме \mathbb{R} можно рассматривать любое поле.

A.8.9. Кольца вычетов

Определение. Числа $a, b \in \mathbb{Z}$ называются сравнимыми по модулю $m \in \mathbb{Z} \setminus \{0\}$, если они имеют равные остатки при делении на m , или, что одно и то же, $m \mid (a - b)$. Обозначается $a \equiv b \pmod{m}$, кратко можно написать $a \equiv_b m$.

Определение. Для $k \in \mathbb{Z}$ множество

$$\bar{k} \stackrel{\text{def}}{=} \{a \in \mathbb{Z} \mid a \equiv k \pmod{m}\} \quad (8.18)$$

называется *классом вычетов* числа k по модулю m .

Замечание. Существует m различных остатков при делении на m , поэтому существует лишь m различных классов вычетов по модулю m .

Замечание 2. Таким образом, множество всех возможных классов вычетов по модулю m образует разбиение \mathbb{Z} на m непересекающихся подмножеств.

Определение. Кольцо вычетов по модулю m — это множество всех классов вычетов по модулю m с операциями сложения и умножения, определёнными следующим образом:

1. $\bar{a} + \bar{b} = \overline{a + b}$
2. $\bar{a} \cdot \bar{b} = \overline{a \cdot b}$

Обозначение: \mathbb{Z}_n или $\mathbb{Z}/n\mathbb{Z}$ (факторкольцо \mathbb{Z} по идеалу $n\mathbb{Z}$).

Кольцо вычетов по модулю m является коммутативным ассоциативным кольцом с единицей.

Предложение.

1. $\bar{k} \in \mathbb{Z}_m$ — делитель нуля $\Leftrightarrow k \nmid m$ и $\gcd(k, m) > 1$.
2. $\bar{k} \in \mathbb{Z}_m^\times \Leftrightarrow \gcd(k, m) = 1$ (критерий обратимости вычета).

Доказательство. \square

1. \bar{k} — делитель нуля $\Leftrightarrow (\bar{k} \neq \bar{0}) \wedge (\exists \bar{l} \neq \bar{0} : \bar{k} \cdot \bar{l} = \bar{0})$. Из первого условия k не делится на m , а из второго

$$\exists l \nmid m : (k \cdot l) : m \quad (8.19)$$

Значит у k и l есть общие делители, так как иначе одно из чисел должно было делиться на m нацело.

Обратно, пусть $\gcd(k, m) > 1$ и при этом k не делится на m . Тогда можно написать, что $k = k' \cdot d$ и $m = m' \cdot d$ для некоторого общего делителя d , меньшего m , но большего 1.

Пусть $l = m'$. Тогда $k \cdot l = k' \cdot d \cdot m' = k' \cdot m$. Значит это делитель нуля.

2. $\bar{k} \in \mathbb{Z}_m^\times \Rightarrow \bar{k} \neq \bar{0}$ и \bar{k} не делитель нуля. По пункту 1, это равносильно тому, что

$$\begin{cases} k \nmid m \\ \gcd(k, m) = 1 \end{cases} \quad (8.20)$$

Обратно, пусть $\bar{k} \neq \bar{0}$ и \bar{k} — неделитель нуля. Рассмотрим произведения

$$\bar{k} \cdot \bar{0}, \bar{k} \cdot \bar{1}, \dots, \bar{k} \cdot \overline{m-1} \quad (8.21)$$

Таких произведений m штук. Если два таких произведения совпали:

$$\bar{k} \cdot \bar{i} = \bar{k} \cdot \bar{j} \Rightarrow \bar{i} = \bar{j}. \quad (8.22)$$

Следовательно, множество таких произведений это просто \mathbb{Z}_m . В частности, $\bar{1} \in \mathbb{Z}_m$, поэтому $\exists \bar{k}, \bar{l} \in \mathbb{Z}_m : \bar{k} \cdot \bar{l} = \bar{1}$. Обратимость доказана.

■

Следствие. \mathbb{Z}_m – поле $\Leftrightarrow m$ – простое число.

Доказательство. $\square \mathbb{Z}_m$ коммутативно, ассоциативно и содержит единицу, поэтому осталось показать, что любой ненулевой вычет обратим. \mathbb{Z}_m – поле $\Leftrightarrow \mathbb{Z}_m^\times = \mathbb{Z}_m \setminus \{\bar{0}\}$. А это случается тогда и только тогда, когда все числа от 1 до $(m - 1)$ взаимно просты с m , а это то же самое, что число m – простое. ■

A.8.10. Характеристика поля

Определение. Пусть K – произвольное поле. Назовём характеристикой поля число

$$\text{char } K = \begin{cases} \min \left\{ p \in \mathbb{N} \mid \underbrace{\bar{1} + \dots + \bar{1}}_{p \text{ раз}} = \bar{0} \right\}, & \exists p \\ 0, & \text{иначе} \end{cases} \quad (8.23)$$

Например,

1. $\text{char } \mathbb{R} = \text{char } \mathbb{Q} = 0$.
2. $\text{char } \mathbb{Z}_p = p$, если p – простое число.

Теорема. Характеристика любого поля либо равна нулю, либо простое число.

Доказательство. \square Пусть $\text{char } K = p > 1$ и p не простое. Тогда $p = k \cdot l$, причём $1 < k, l < p$.

$$\underbrace{1 + \dots + 1}_k \neq 0 \quad (8.24)$$

$$\underbrace{1 + \dots + 1}_l \neq 0 \quad (8.25)$$

Но при перемножении эти сумм получим

$$\underbrace{1 + \dots + 1}_{k \cdot l = p} \underset{\text{характ.}}{=} 0 \quad (8.26)$$

Значит в K есть делитель нуля, но это противоречие, так как в поле нет делителя нуля(они необратимы), а в поле все элементы обратимы. ■

Предложение. Если $\text{char } K = p > 0$, то $\forall x, y \in K$:

$$(x + y)^p = x^p + y^p. \quad (8.27)$$

Доказательство. \square Согласно биному Ньютона,

$$(x + y)^p = x^p + C_p^1 x^{p-1} y + \dots + C_p^k x^{p-k} y^k + \dots + y^p \quad (8.28)$$

Поскольку $C_p^k = \frac{p!}{k!(p-k)!}$ целое, и числитель делится на p , а знаменатель нет, то C_p^k делится на p . Следовательно, все члены бинома Ньютона, кроме первого и последнего, равны нулю в поле характеристики p :

$$C_p^k = \underbrace{1 + \dots + 1}_p + \dots + \underbrace{1 + \dots + 1}_p = 0 \quad (8.29)$$

Поэтому остаются только x^p и y^p . ■

Следствие. Если $\text{char } K = p > 0$, то $\forall x, y \in K$:

$$(x_1 + \dots + x_n)^p = x_1^p + \dots + x_n^p \quad (8.30)$$

A.8.11. Малая теорема Ферма

Пусть p – простое число. Тогда $\forall n \in \mathbb{Z}$:

$$n^p \equiv n \pmod{p} \quad (8.31)$$

Доказательство. \square Рассмотрим \mathbb{Z}_p : Надо доказать, что

$$\overline{n^p} = \overline{n} \quad (8.32)$$

Тогда:

$$\overline{n} = \overline{1} + \dots + \overline{1} \Rightarrow \overline{n^p} = \overline{1}^p + \dots + \overline{1}^p = \overline{1} + \dots + \overline{1} = \overline{n} \quad (8.33)$$

Что и требовалось доказать. ■

A.8.12. Китайская теорема об остатках

 *Теорема.* Пусть $n = n_1 \cdot n_2 \dots n_k$, $\gcd(n_i, n_j) = 1 \forall i \neq j$. Тогда

$$\mathbb{Z}/n\mathbb{Z} \simeq \mathbb{Z}/n_1\mathbb{Z} \times \mathbb{Z}/n_2\mathbb{Z} \times \dots \times \mathbb{Z}/n_k\mathbb{Z} \quad (8.34)$$

Доказательство. \square Построим отображение и докажем что оно является изоморфизмом колец:

$$f : \mathbb{Z}/n\mathbb{Z} \rightarrow \mathbb{Z}/n_1\mathbb{Z} \times \mathbb{Z}/n_2\mathbb{Z} \times \dots \times \mathbb{Z}/n_k\mathbb{Z} \quad (8.35)$$

Отправим остаток по модулю n : $[m]_n \rightarrow ([m]_{n_1}, \dots, [m]_{n_k})$. Надо проверить, что

$$\begin{aligned} f([m_1]_n + [m_2]_n) &= f([m_1]_n) + f([m_2]_n) \Leftrightarrow \\ \Leftrightarrow f([m_1 + m_2]_n) &= f([m_1]_n) + f([m_2]_n) \end{aligned} \tag{8.36}$$

Это верно, так как $\forall i = 1, \dots, k : [m_1 + m_2]_{n_i} = [m_1]_{n_i} + [m_2]_{n_i}$. Аналогично проверяется согласованность по умножению, поэтому f — гомоморфизм.

Докажем что f — инъективно. Для этого надо проверить, что $\ker f = \{0\}$. Пусть $[m]_n \rightarrow 0$. Следовательно, $n_1 \mid m, \dots, n_k \mid m$. Так как n_i попарно взаимно просты, то $n \mid m \Rightarrow [m]_n = [0]_n$.

■

A.9. Кольцо многочленов

Определение. Пусть K — ассоциативное, коммутативное кольцо с единицей. Кольцом многочленов от одной переменной над K называется кольцо $K[x]$, удовлетворяющее следующим условиям:

1. Кольцо многочленов должно содержать кольцо K или подкольцо, изоморфное K .

$$K[x] \supset K \quad (9.1)$$

2. Существует элемент x , называемый переменной:

$$K[x] \supset x \notin K \quad (9.2)$$

3. $\forall f \neq 0 \exists!$ представление f в виде:

$$f = a_0 + a_1x + a_2x^2 + \dots + a_nx^n, \quad (9.3)$$

причём $a_i \in K$, $a_n \neq 0$.

Определение. Степенью многочлена f называется наибольший показатель степени переменной x в его разложении. Обозначение: $\deg f$.

Замечание. У нулевого многочлена степени нет, или её формально можно считать равной $-\infty$.

Определение. a_0, a_1, \dots, a_n называются коэффициентами многочлена f . Коэффициент a_n называется старшим коэффициентом.

Определение. Степени x^0, x^1, \dots, x^n называются мономами или одночленами.

Замечание. Если $c_0 + c_1x + \dots + c_nx^n = 0$, то $c_0 = c_1 = \dots = c_n = 0$. Если бы это было не так, то взяв

$$f = a_0 + a_1x + \dots + a_nx^n \neq 0, \quad (9.4)$$

тогда для f найдётся другое представление

$$f = (a_0 + c_0) + (a_1 + c_1)x + \dots + (a_n + c_n)x^n, \quad (9.5)$$

что противоречит единственности представления многочлена.

Замечание. Если разрешить

$$f = \sum_{k=0}^{\infty} a_k x^k, \quad (9.6)$$

так, чтобы только конечное число коэффициентов было ненулевыми, то свойство 3 можно сформулировать так: $\forall f \neq 0 \exists!$ представление f в виде бесконечной суммы.

A.9.1. Единственность кольца многочленов

 **Теорема.** Кольцо многочленов $K[x]$ единственно с точностью до изоморфизма.

Доказательство. \square Пусть $f = \sum_{n \geq 0} a_n x^n \in K[x]$ и $g = \sum_{n \geq 0} b_n x^n \in K[x]$. Тогда их сумма равна

$$f + g = \sum_{n \geq 0} (a_n + b_n) x^n, \quad (9.7)$$

а произведение равно

$$f \cdot g = \sum_{k \geq 0} a_k x^k \cdot \sum_{l \geq 0} b_l x^l = \sum_{k, l \geq 0} a_k b_l x^{k+l} = \sum_{n \geq 0} \left(\sum_{\substack{(k, l): \\ k+l=n}} a_k b_l \right) x^n. \quad (9.8)$$

Коэффициенты в суммах и произведениях зависят только от коэффициентов сомножителей. Пусть $K[y]$ – другое кольцо многочленов. Построим изоморфизм $\varphi : K[x] \xrightarrow{\sim} K[y]$ следующим образом:

$$\varphi \left(\sum_{n \geq 0} a_n x^n \right) = \sum_{n \geq 0} a_n y^n. \quad (9.9)$$

1. Проверим, что φ биективно. Так как многочлены имеют единственное представление в виде комбинации коэффициентов, у у многочленов из $K[x]$ и $K[y]$ при отображении φ один и тот же набор коэффициентов, то элемент и его образ однозначно соответствуют друг другу.
2. Проверим, что φ – гомоморфизм. Так как результат операций сложения и умножения многочленов зависит только от коэффициентов, то при отображении φ сумма и произведение сохраняются.

Таким образом, кольца $K[x]$ и $K[y]$ изоморфны. ■

A.9.2. Существование кольца многочленов

Определение. Последовательность $a_0, a_1, \dots, a_k, \dots$ элементов кольца K называется финитной, если $\exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N a_n = 0$.

Обозначим K^∞ множество всех финитных последовательностей элементов кольца K .

Определим на K^∞ операцию суммы. $\forall a, b \in K^\infty$:

$$(a_0, a_1, \dots, a_n, \dots) + (b_0, b_1, \dots, b_n, \dots) = (a_0 + b_0, a_1 + b_1, \dots, a_n + b_n, \dots). \quad (9.10)$$

$$a \cdot b = \left(a_0 \cdot b_0, a_0 \cdot b_1 + a_1 \cdot b_0, a_0 \cdot b_2 + a_1 \cdot b_1 + a_2 \cdot b_0, \dots, \sum_{(k,l): k+l=n} a_k \cdot b_l, \dots \right). \quad (9.11)$$

Проверим свойства кольца на K^∞ .

1. Коммутативность сложения и умножения следует из коммутативности в K .
2. Ассоциативность сложения следует из ассоциативности в K .
3. Ассоциативность умножения. Пусть $a, b, c \in K^\infty$, $f = a \cdot b$, $g = (a \cdot b) \cdot c$, $u = b \cdot c$, $v = a \cdot (b \cdot c)$. Тогда мы хотели бы доказать, что $g = v$. Рассмотрим n -ый коэффициент g :

$$g_n = \sum_{\substack{(k,l): \\ k+l=n}} f_k \cdot c_l = \sum_{\substack{k,l \geq 0 \\ k+l=n}} \left(\sum_{\substack{i,j \geq 0 \\ i+j=k}} a_i \cdot b_j \right) \cdot c_l = \sum_{\substack{i,j,l \geq 0 \\ i+j+l=n}} a_i \cdot b_j \cdot c_l. \quad (9.12)$$

$$v_n = \sum_{\substack{(i,m): \\ i+m=n}} a_i \cdot u_m = \sum_{\substack{i,m \geq 0 \\ i+m=n}} a_i \cdot \left(\sum_{\substack{j,l \geq 0 \\ j+l=m}} b_j \cdot c_l \right) = \sum_{\substack{i,j,l \geq 0 \\ i+j+l=n}} a_i \cdot b_j \cdot c_l. \quad (9.13)$$

Таким образом, $g_n = v_n$ для всех $n \in \mathbb{N}$, значит, $g = v$.

4. Дистрибутивность умножения относительно сложения. $a \cdot (b + c) = a \cdot b + a \cdot c$. Пусть $f = a \cdot (b + c)$, $g = a \cdot b + a \cdot c$. Рассмотрим n -ый коэффициент f :

$$f_n = \sum_{\substack{(k,l): \\ k+l=n}} a_k \cdot (b + c)_l = \sum_{\substack{(k,l): \\ k+l=n}} a_k \cdot (b_l + c_l) = \sum_{\substack{(k,l): \\ k+l=n}} a_k \cdot b_l + \sum_{\substack{(k,l): \\ k+l=n}} a_k \cdot c_l. \quad (9.14)$$

$$g_n = (a \cdot b)_n + (a \cdot c)_n = \sum_{\substack{(k,l): \\ k+l=n}} a_k \cdot b_l + \sum_{\substack{(k,l): \\ k+l=n}} a_k \cdot c_l. \quad (9.15)$$

Таким образом, $f_n = g_n$ для всех $n \in \mathbb{N}$, значит, $f = g$.

5. Нулевой элемент: $0 = (0, \dots, 0, \dots)$

6. Противоположный элемент: для $a = (a_0, a_1, \dots, a_n, \dots)$ его противоположный элемент равен $-a = (-a_0, -a_1, \dots, -a_n, \dots)$.
7. Единичный элемент: $1 = (1, 0, 0, \dots, 0, \dots)$.

Поэтому K^∞ является ассоциативным, коммутативным кольцом с единицей.

8. $K^\infty \supset (a_0, 0, 0, \dots, 0, \dots)$. Если сложить две такие последовательности, то получится $(a_0 + b_0, 0, 0, \dots, 0, \dots)$. Если перемножить, то получится $(a_0 \cdot b_0, 0, 0, \dots, 0, \dots)$. Таким образом, множество таких последовательностей изоморфно K .
9. Пусть $x = (0, 1, 0, 0, \dots, 0, \dots)$ — переменная.
10. $x^n = (0, 0, \dots, 1, 0, \dots, 0, \dots)$, где 1 стоит на n -ой позиции.

Докажем по индукции. \square База: $n = 0$. Тогда $x^0 = (1, 0, 0, \dots, 0, \dots) = 1$. Пусть верно для $n \in \mathbb{N}$: $x^n = (0, 0, \dots, 1, 0, \dots, 0, \dots)$. Тогда

$$\begin{aligned} x^{n+1} &= x^n \cdot x = (0, 0, \dots, 1, 0, \dots, 0, \dots) \cdot (0, 1, 0, 0, \dots, 0, \dots) = \\ &= (0, 0, \dots, 0, 1, 0, \dots, 0, \dots) = x^{n+1} \blacksquare \end{aligned} \tag{9.16}$$

11. $\forall a = (a_0, a_1, \dots, a_n, \dots) \in K^\infty$:

$$\begin{aligned} a &= (a_0, 0, 0, \dots, 0, \dots) + (0, a_1, 0, \dots, 0, \dots) + \dots + (0, 0, \dots, a_n, 0, \dots) = \\ &= a_0 x^0 + a_1 x^1 + \dots + a_n x^n + \dots \end{aligned} \tag{9.17}$$

причём коэффициенты этой линейной комбинации определены однозначно по представлению a .

Поэтому K^∞ является моделью кольца многочленов над K и значит $K[x]$ существует.

A.9.3. Алгебраические свойства многочленов

Определение. Кольцо K называется целостным, если K — ассоциативное, коммутативное кольцо с единицей и без делителей нуля.

1. Кольцо \mathbb{Z} целостно.
2. Любое поле есть область целостности.

 *Теорема.* Если $f, g \in K[x]$, $f, g \neq 0$ и K — область целостности, то $f \cdot g \neq 0$ и

$$\deg(f \cdot g) = \deg f + \deg g \tag{9.18}$$

Доказательство. \square Пусть $f = a_0 + a_1x + \dots + a_nx^n$, $g = b_0 + b_1x + \dots + b_mx^m$, где $a_n \neq 0$, $b_m \neq 0$.

$$f \cdot g = \sum_{\substack{i=0, \dots, n \\ j=0, \dots, m}} a_i \cdot b_j x^{i+j} = a_n \cdot b_m x^{n+m} + \sum_{\substack{(i,j): \\ i+j < n+m}} a_i \cdot b_j x^{i+j} \neq 0, \quad (9.19)$$

причём $\deg(f \cdot g) = n + m = \deg f + \deg g$. ■

Замечание. Если счиать $\deg 0 = -\infty$, то теорема верна для нулевого многочлена.

 *Следствие.* $K[x]$ над областью целостности K тоже является областью целостности, причём его группа обратимых по умножению элементов равна группе обратимых элементов K^\times .

$$K[x]^\times = K^\times \quad (9.20)$$

Доказательство. \square

1. Так как произведение ненулевых многочленов ненулевое, то в $K[x]$ нет делителей нуля, значит, $K[x]$ – область целостности.
2. Пусть $f \in K[x]^\times$. Тогда существует $g \in K[x]$: $f \cdot g = 1$. По теореме выше $\deg(f \cdot g) = \deg f + \deg g$. Так как $\deg 1 = 0$, то $\deg f + \deg g = 0$. Следовательно, $\deg f = \deg g = 0$ и $f, g \in K$. Поэтому если многочлен f обратим в $K[x]$, то он лежит и обратим в K , то есть $f \in K^\times$. ■

A.9.4. Кольцо многочленов над полем

Всякий многочлен $f = a_0 + a_1x + \dots + a_nx^n \in K[x]$ определяет функцию $f : K \rightarrow K$ по правилу $f(t) = a_0 + a_1t + \dots + a_nt^n$. Такие функции называются полиномиальными.

A.9.4.1. Задача полиномиальной интерполяции

Пусть даны n различных элементов $x_1, \dots, x_n \in K$, где K – поле, и ещё n элементов $y_1, \dots, y_n \in K$. Требуется найти полиномиальную функцию $f : K \rightarrow K$, такую что $f(x_i) = y_i, \forall i = 1, \dots, n$.

A.9.4.2. Теорема об интерполяции

 *Теорема.* Пусть K – поле, $x_1, \dots, x_n \in K$ – различные элементы, $y_1, \dots, y_n \in K$ – произвольные элементы. Тогда существует единственный многочлен $f \in K[x]$ степени меньше n , такой что $f(x_i) = y_i, \forall i = 1, \dots, n$.

Доказательство. \square Пусть $f(x) = a_0 + a_1x + \dots + a_{n-1}x^{n-1}$.

$$\begin{cases} f(x_1) = a_0 + a_1 x_1 + \dots + a_{n-1} x_1^{n-1} = y_1 \\ f(x_2) = a_0 + a_1 x_2 + \dots + a_{n-1} x_2^{n-1} = y_2 \\ \dots \\ f(x_n) = a_0 + a_1 x_n + \dots + a_{n-1} x_n^{n-1} = y_n \end{cases} \quad (9.21)$$

— система линейных уравнений относительно неизвестных a_0, a_1, \dots, a_{n-1} . Определитель матрицы этой системы есть определитель Вандермонда с точностью до транспонирования:

$$\Delta = \begin{vmatrix} 1 & x_1 & x_1^2 & \dots & x_1^{n-1} \\ 1 & x_2 & x_2^2 & \dots & x_2^{n-1} \\ \dots & & & & \\ 1 & x_n & x_n^2 & \dots & x_n^{n-1} \end{vmatrix} = \prod_{(1 \leq i < j \leq n)} (x_j - x_i) \neq 0. \quad (9.22)$$

Так как все x_i различны, то определитель $\Delta \neq 0$ и система имеет единственное решение. ■

По правилу Крамера, решение системы можно записать явно:

$$a_j = \frac{\Delta_j}{\Delta}, \quad (9.23)$$

где в Δ_j мы заменили $(j+1)$ -ый столбец матрицы Δ на столбец свободных членов:

$$\Delta_j = \begin{vmatrix} 1 & x_1 & \dots & x_1^{j-1} & y_1 & x_1^{j+1} & \dots & x_1^{n-1} \\ 1 & x_2 & \dots & x_2^{j-1} & y_2 & x_2^{j+1} & \dots & x_2^{n-1} \\ \dots & & & & & & & \\ 1 & x_n & \dots & x_n^{j-1} & y_n & x_n^{j+1} & \dots & x_n^{n-1} \end{vmatrix} = \sum_{i=1}^n \left(y_i \cdot \prod_{\substack{(1 \leq m \leq n) \\ m \neq i}} (x_m - x_i) \right). \quad (9.24)$$

Тогда многочлен интерполяции можно записать в виде:

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \left(y_i \cdot \prod_{\substack{(1 \leq m \leq n) \\ m \neq i}} \left(\frac{x - x_m}{x_i - x_m} \right) \right). \quad (9.25)$$

Этот многочлен называется интерполяционным многочленом Лагранжа.

 **Предложение.** Пусть K — бесконечное поле, $f = \sum_{k \geq 0} a_k x^k$, $g = \sum_{k \geq 0} b_k x^k \in K[x]$. Тогда имеет место эквивалентность функционального и формального равенства:

$$f(c) = g(c) \quad \forall c \in K \Leftrightarrow f = g \quad (9.26)$$

Доказательство. \square Из формального равенства очевидно следует функциональное равенство. Докажем обратное.

$$f = a_0 + a_1x + \dots + a_nx^n, g = b_0 + b_1x + \dots + b_mx^m. \quad (9.27)$$

Выберем $n + 1$ различных элементов $x_0, x_1, \dots, x_n \in K$, так как поле K бесконечно. Обозначим $y_i = f(x_i) = g(x_i), \forall i = 0, 1, \dots, n$. Так как $\deg f \leq n, \deg g \leq m$, то по теореме об интерполяции многочлен f единственен, следовательно, $f = g$. ■

A.9.5. Деление многочленов с остатком

 *Теорема.* Пусть K – поле, $\forall f, g \in K[x], g \neq 0 \exists! q, r \in K[x]$:

$$\begin{aligned} f &= q \cdot g + r, \\ \deg r &< \deg g \end{aligned} \quad (9.28)$$

условие на степени можно убрать, если $\deg 0 = -\infty$. Многочлен q называется частным, r – остатком от деления f на g . Если $r = 0$, то говорят, что $g \mid f$ (g делит f).

Доказательство. \square

1. Существование. Если $f = 0$, то $q = 0, r = 0$.

Пусть $f \neq 0, \deg f = n, \deg g = m$. Если $n < m$, то $q = 0, r = f$. Тогда $f = a_0 + a_1x + \dots + a_nx^n$ и $g = b_0 + b_1x + \dots + b_mx^m$, где $a_n \neq 0, b_m \neq 0$. Проведём индукцию по n .

1.1. Если $n < m$, то $q = 0, r = f$.

1.2. Пусть $n \geq m$. Тогда умножим g на одночлен cx^{n-m} , где $c = \frac{a_n}{b_m}$. Тогда старшие члены f и $cx^{n-m} \cdot g$ совпадут и их можно вычесть:

$$\tilde{f} = f - cx^{n-m} \cdot g = a'_0 + a'_1x + \dots + a'_{n-1}x^{n-1}, \quad (9.29)$$

где $\deg \tilde{f} < n$. Если $\deg \tilde{f} = 0$, то $g \mid f : q = \frac{a_n}{b_m}x^{n-m}, r = 0$.

Если же $\deg \tilde{f} > 0$, то по предположению индукции существуют \tilde{q}, r такие, что

$$\begin{aligned} \tilde{f} &= \tilde{q} \cdot g + r, \\ \deg r &< \deg g. \end{aligned} \quad (9.30)$$

Сам многочлен f можно записать как

$$f = \tilde{f} + cx^{n-m} \cdot g = (\tilde{q} + cx^{n-m}) \cdot g + r. \quad (9.31)$$

2. Единственность. Пусть существуют $q_1, r_1, q_2, r_2 \in K[x]$ такие, что

$$\begin{aligned} f &= q_1 \cdot g + r_1, \\ \deg r_1 &< \deg g, \end{aligned} \tag{9.32}$$

и

$$\begin{aligned} f &= q_2 \cdot g + r_2, \\ \deg r_2 &< \deg g. \end{aligned} \tag{9.33}$$

Тогда

$$(q_1 - q_2) \cdot g = r_2 - r_1. \tag{9.34}$$

Степень многочлена в правой части $\deg(r_2 - r_1) < \deg g$. А степень многочлена в левой части $\deg((q_1 - q_2) \cdot g) \geq \deg g$, если $q_1 \neq q_2$. Противоречие. Следовательно, $q_1 = q_2$ и $r_1 = r_2$. ■

A.9.6. Теорема Безу

 **Теорема.** Пусть K – поле, $f \in K[x]$, $x_0 \in K$. Тогда при делении f на многочлен $x - x_0$ получается остаток $f(x_0)$:

$$f(x) = q(x) \cdot (x - x_0) + f(x_0) \tag{9.35}$$

Доказательство. □ По теореме о делении с остатком, существуют $q, r \in K[x]$ такие, что

$$\begin{aligned} f(x) &= q(x) \cdot (x - x_0) + r, \\ \deg r &< \deg(x - x_0) = 1. \end{aligned} \tag{9.36}$$

Значит остаток это константа: $r \in K$. Подставим $x = x_0$:

$$f(x_0) = q(x_0) \cdot (x_0 - x_0) + r = r. \blacksquare \tag{9.37}$$

 **Следствие.** Пусть K – поле, $f \in K[x]$. Тогда $x_0 \in K$ является корнем многочлена f , если и только если $(x - x_0) \mid f(x)$.

Определение. Кратность значения x_0 многочлена $f \in K[x]$ это такое наибольшее целое число $k \geq 0$, что $(x - x_0)^k \mid f(x)$.

Это тоже самое, что $f(x) = (x - x_0)^k \cdot q(x)$, где $q(x_0) \neq 0$.

Кратность, равная нулю, означает, что x_0 не является корнем многочлена.

Определение. Корень многочлена называется простым, если его кратность равна единице.

Определение. Корень многочлена называется кратным, если его кратность больше единицы.

A.9.7. Теорема о количестве корней ненулевого многочлена

 **Теорема.** Пусть K – поле, $f \in K[x]$, $f \neq 0$. Тогда число корней многочлена f с учётом кратности не больше $\deg f$.

Доказательство. \square Индукция по степени многочлена. Если $n = \deg f = 0$, то f – константа и корней нет.

Если f не имеет корней, то утверждение верно. Иначе возьмём корень $x_0 \in K$ многочлена f и возьмём $g \in K[x]$, для которого $g(x_0) \neq 0$. Пусть так же кратность корня x_0 равна k_0 .

$$f(x) = (x - x_0)^{k_0} \cdot g(x), \quad (9.38)$$

причём $\deg g = \deg f - k_0$. По предположению индукции многочлен g имеет лишь конечное число корней x_1, x_2, \dots, x_m с кратностями k_1, k_2, \dots, k_m , причём $k_1 + \dots + k_m \leq n - k_0$ по предположению индукции. Тогда многочлен f имеет корни $x_0, x_1, x_2, \dots, x_m$ с кратностями $k_0, k_1, k_2, \dots, k_m$. Следовательно, $k_0 + k_1 + \dots + k_m \leq k_0 + (n - k_0) = n$. ■

A.9.8. Производная многочлена

Определение. Пусть $f = a_0 + a_1 x + a_2 x^2 + \dots + a_n x^n \in K[x]$. Его формальная производная определяется как

$$f' = a_1 + 2a_2 x + 3a_3 x^2 + \dots + n a_n x^{n-1} = \sum_{k=1}^n k a_k x^{k-1}. \quad (9.39)$$

при $K = \mathbb{R}$ формальная производная совпадает с обычной производной полиномиальной функции $f(x)$

$$f'(x_0) = \lim_{\varepsilon \rightarrow 0} \frac{f(x_0 + \varepsilon) - f(x_0)}{\varepsilon}. \quad (9.40)$$

Свойства производной многочлена:

1. Производная суммы многочленов равна сумме производных:

$$(f + g)' = f' + g' \quad (9.41)$$

2. Константу можно выносить за знак производной:

$$(c \cdot f)' = c \cdot f' \quad (9.42)$$

первые два свойства называются свойствами линейности.

3. Производная произведения многочленов подчиняется правилу Лейбница:

$$(f \cdot g)' = f' \cdot g + f \cdot g' \quad (9.43)$$

Доказательство. \square Пусть $f = \sum_{k \geq 0} a_k x^k$ и $g = \sum_{l \geq 0} b_l x^l$. Тогда

$$f \cdot g = \sum_{k,l \geq 0} a_k b_l x^{k+l} \quad (9.44)$$

$$\begin{aligned} (f \cdot g)' &= \sum_{k,l \geq 0} (k+l) a_k b_l x^{k+l-1} = \sum_{k,l \geq 0} k a_k b_l x^{k+l-1} + \sum_{k,l \geq 0} l a_k b_l x^{k+l-1} = \\ &= \sum_{k \geq 0} k a_k x^{k-1} \cdot \sum_{l \geq 0} b_l x^l + \sum_{k \geq 0} a_k x^k \cdot \sum_{l \geq 0} l b_l x^{l-1} = f' \cdot g + f \cdot g'. \blacksquare \end{aligned} \quad (9.45)$$

4. Производная произведения нескольких многочленов:

$$(f_1 \cdot f_2 \cdot \dots \cdot f_k)' = \sum_{i=1}^k (f_1 \cdot \dots \cdot f_{i-1} \cdot f'_i \cdot f_{i+1} \cdot \dots \cdot f_k) \quad (9.46)$$

Доказательство. \square Индукция по числу сомножителей. База: $k = 2$ — верно по правилу Лейбница. Пусть верно для $k \in \mathbb{N}$. Тогда для $k + 1$:

$$\begin{aligned} (f_1 \cdot f_2 \cdot \dots \cdot f_k \cdot f_{k+1})' &= (f_1 \cdot f_2 \cdot \dots \cdot f_k)' \cdot f_{k+1} + (f_1 \cdot f_2 \cdot \dots \cdot f_k) \cdot f'_{k+1} = \\ &= \left(\sum_{i=1}^k (f_1 \cdot \dots \cdot f_{i-1} \cdot f'_i \cdot f_{i+1} \cdot \dots \cdot f_k) \right) \cdot f_{k+1} + (f_1 \cdot f_2 \cdot \dots \cdot f_k) \cdot f'_{k+1} = \\ &= \sum_{i=1}^{k+1} (f_1 \cdot \dots \cdot f_{i-1} \cdot f'_i \cdot f_{i+1} \cdot \dots \cdot f_{k+1}). \blacksquare \end{aligned} \quad (9.47)$$

5. Производная степени многочлена:

$$(f^k)' = k \cdot f^{k-1} \cdot f' \quad (9.48)$$

Доказательство. \square Индукция по k . База: $k = 1$ — верно. Пусть верно для $k \in \mathbb{N}$. Тогда для $k + 1$:

$$(f^{k+1})' = (f^k \cdot f)' = (f^k)' \cdot f + f^k \cdot f' = k \cdot f^{k-1} \cdot f' \cdot f + f^k \cdot f' = (k+1) \cdot f^k \cdot f' \quad (9.49) \blacksquare$$

6. Производная степени линейного двучлена:

$$((x - x_0)^k)' = k \cdot (x - x_0)^{k-1} \quad (9.50)$$

A.9.9. Высшая производная многочлена

Определение. Высшей производной k -го порядка многочлена f называется многочлен, определяемый индуктивно:

$$\begin{aligned} f^{(k)} &= (f^{(k-1)})', \\ f^{(0)} &= f. \end{aligned} \tag{9.51}$$

 *Предложение.* Пусть дано поле K .

1. x_0 является кратным корнем многочлена $f \in K[x]$ тогда и только тогда, когда он является корнем многочлена f и его первой производной.
2. Если $\text{char } K = 0$, то x_0 является корнем кратности k многочлена $f \in K[x]$ тогда и только тогда, когда

$$\begin{aligned} f(x_0) &= f'(x_0) = f^{(2)}(x_0) = \dots = f^{(k-1)}(x_0) = 0, \\ f^k(x_0) &\neq 0. \end{aligned} \tag{9.52}$$

Доказательство. \square Пусть кратность корня x_0 многочлена f равна k . Тогда

$$f(x) = (x - x_0)^k \cdot g(x), g(x_0) \neq 0. \tag{9.53}$$

Продифференцируя f , получаем

$$f'(x) = k(x - x_0)^{k-1} \cdot g(x) + (x - x_0)^k \cdot g'(x) = (x - x_0)^{k-1} \cdot (k \cdot g(x) + (x - x_0) \cdot g'(x)).$$

Пусть $h = k \cdot g(x) + (x - x_0) \cdot g'(x)$.

1. Если $k > 1$, то $k - 1 > 0$ и поэтому $(x - x_0) \mid f'(x)$, то есть x_0 — корень многочлена f' .
2. Если $k = 1$, то $f'(x) = h(x)$ и $h(x_0) = k \cdot g(x_0) = g(x_0) \neq 0$, то есть x_0 не является корнем многочлена f' .

Теперь докажем второе утверждение. $h(x_0) = k \cdot g(x_0)$, так как $\text{char } K = 0$, то $k \cdot g(x_0) \neq 0$. Значит кратность корня x_0 многочлена f' равна $k - 1$. Повторяя этот процесс, получаем, что $f(x_0) = f'(x_0) = \dots = f^{(k-1)}(x_0) = 0, f^{(k)}(x_0) \neq 0$. ■

A.9.10. Разложение многочлена на линейные множители над полем

 *Предложение.* Если K — поле, то $\forall x_0 \in K$

$$K[x] = K[x - x_0] \quad (9.55)$$

то есть \forall многочлен $f \in K[x]$ можно единственным способом представить в виде

$$f(x) = a_0 + a_1(x - x_0) + a_2(x - x_0)^2 + \dots + a_n(x - x_0)^n, \quad (9.56)$$

$$a_i \in K.$$

Доказательство. \square

1. Существование. Пусть $f = a_0 + a_1x + \dots + a_nx^n, a_n \neq 0$. Обозначим $y = x - x_0$.

Тогда

$$f(x) = a_0 + a_1(y + x_0) + a_2(y + x_0)^2 + \dots + a_n(y + x_0)^n. \quad (9.57)$$

Раскроем скобки и приведём подобные слагаемые по степеням y .

$$f(x) = c_0 + c_1y + c_2y^2 + \dots + c_ny^n, \quad (9.58)$$

$$c_i \in K.$$

2. Единственность. Индукция по $n = \deg f$. Если $n = 0$, то $f = a_0 = c_0$. Пусть верно для степеней меньше $n \in \mathbb{N}$, представим, что

$$f(x) = c_0 + c_1(x - x_0) + c_2(x - x_0)^2 + \dots + c_n(x - x_0)^n = c_nx^n + \dots \quad (9.59)$$

Поэтому $c_n = a_n$. Рассмотрим разность

$$f(x) - c_n(x - x_0)^n = c_0 + c_1(x - x_0) + c_2(x - x_0)^2 + \dots + c_{n-1}(x - x_0)^{n-1} \quad (9.60)$$

Так как f задан, то разность задана однозначно. По предположению индукции коэффициенты c_0, c_1, \dots, c_{n-1} определены однозначно, поэтому весь набор определён однозначно. ■

 *Теорема.* Пусть $f(x) = \sum_{l \geq 0} c_l(x - x_0)^l$, тогда

$$c_k \cdot k! = f^{(k)}(x_0) \quad (9.61)$$

Доказательство. \square Посмотрим, что будет при дифференцировании линейного двучлена:

$$\left((x - x_0)^l \right)^{(k)} = \begin{cases} 0, & l < k \\ k!, & l = k \\ l(l-1)\dots(l-k+1)(x - x_0)^{l-k}, & l > k. \end{cases} \quad (9.62)$$

Продифференцируем f k раз:

$$f^{(k)}(x) = \sum_{l \geq 0} c_l \left((x - x_0)^l \right)^{(k)} = c_k k! + \sum_{l > k} c_l l(l-1)\dots(l-k+1)(x - x_0)^{l-k}. \quad (9.63)$$

Подставим $x = x_0$ и получим желаемое равенство. ■

 *Следствие.* Если K – поле, $\text{char } K = 0$, $f \in K[x]$ и $\deg f = n$, то

$$f(x) = \sum_{k=0}^n \frac{f^{(k)}(x_0)}{k!} \cdot (x - x_0)^k \quad (9.64)$$

(формула Тейлора для многочленов).

Доказательство. □ Так как $\text{char } K = 0$, $k! \neq 0$, и на него можно разделить многочлен, записанный в форме из теоремы выше. ■

A.10. Теория делимости в кольцах многочленов

Определение. Пусть A — область целостности и $a, b \in A$, $a, b \neq 0$. Говорят, что $b \mid a$ (b делит a), если $\exists c \in A : a = b \cdot c$.

Определение. Если $a \mid b$ и $b \mid a$, то эти элементы называются ассоциированными.

Обозначение: $a \sim b$.

A.10.1. Свойства ассоциированности

Пусть A — область целостности и рассматриваемые элементы лежат в ней.

1. $a \sim b \Leftrightarrow a = b \cdot u$, где $u \in A^\times$.

Доказательство. \square

- $\Rightarrow.$ $(a \mid b) \wedge (b \mid a) \Leftrightarrow b = a \cdot v$ и $a = b \cdot u$. Отсюда $b = b \cdot u \cdot v$, и так как в кольце A нет делителей нуля, то можно сократить на b и получить $u \cdot v = 1 \Rightarrow u, v \in A^\times$.
- $\Leftarrow.$ $a = b \cdot u, u \in A^\times \Rightarrow a \cdot u^{-1} = b \Rightarrow (a \mid b) \wedge (b \mid a) \Rightarrow a \sim b$. ■

2. Ассоциированность — отношение эквивалентности.

Доказательство. \square

- Рефлексивность. $a \sim a$.
- Симметричность. $a \sim b \Rightarrow a = b \cdot u, u \in A^\times \Rightarrow b = a \cdot u^{-1}, u^{-1} \in A^\times \Rightarrow b \sim a$.
- Транзитивность. $a \sim b \sim c \Rightarrow a = b \cdot u, b = c \cdot v \Rightarrow a = c \cdot u \cdot v \Rightarrow a \sim c$, где $u, v \in A^\times$. ■

3. Ассоциированность не влияет на делимость. Пусть $a \sim a'$, $b \sim b'$. Тогда $b \mid a \Leftrightarrow b' \mid a'$.

Доказательство. \square Так как отношение ассоциированности симметрично, то достаточно доказать в одну сторону.

Если $a \sim a'$ и $b \sim b'$, то $a = a' \cdot u$, $b = b' \cdot v$, где $u, v \in A^\times$. Если $b \mid a$, то $a = b \cdot c$. Тогда $a' \cdot u = b' \cdot v \cdot c$. Тогда, умножив на u^{-1} , получим $a' = b' \cdot (v \cdot c \cdot u^{-1})$. ■

Например,

1. В \mathbb{Z} : $a \sim b \Leftrightarrow a = \pm b$, так как в \mathbb{Z} обратимы только $\{-1, 1\}$.
2. $K[x]$ над полем K : $f \sim g \Leftrightarrow f = g \cdot \lambda$, $\lambda \in K^\times$.

A.10.2. Наибольший общий делитель

Определение. Пусть $a, b \in A$, $a, b \neq 0$, где A – область целостности. Наибольший общий делитель(НОД) элементов a и b это такой элемент $d \in A$, что

1. Он делит оба элемента: $d | a$ и $d | b$.
2. Он наибольший в том смысле, что любой общий делитель a и b делит и его тоже:
 $\forall c \in A \setminus \{0\} : c | a, c | b \Rightarrow c | d$.

Обозначение. $\gcd(a, b)$.

Определение. Элементы области целостности $a, b \in A$ называются взаимно простыми, если $\gcd(a, b) = 1$, то есть a и b не имеют общих делителей, кроме обратимых элементов.



Теорема. Если $\gcd(a, b)$ существует, то он определён однозначно с точностью до ассоциированности.

Доказательство. \square Пусть d и d' – два наибольших общих делителя a и b . Тогда $d, d' | a, b$. Тогда $d' | d$ и $d | d'$ по свойству 2 НОД. Значит $d \sim d'$. ■

A.10.3. Евклидовы кольца

Определение. Целостное кольцо A называется евклидовым, если на множество его ненулевых элементов задана функция

$$N : A \setminus \{0\} \rightarrow \mathbb{Z}_+ = \{0, 1, 2, \dots\}, \quad (10.1)$$

которая обладает следующими свойствами:

1. Монотонность: $N(a \cdot b) \geq N(a)$, причём $N(a \cdot b) \Leftrightarrow b \in A^\times$.
2. $\forall a, b \in A, b \neq 0 \exists q, r \in A : a = b \cdot q + r$, причём $N(r) < N(b)$ или $r = 0$.

Если считать, что $N(0) = -\infty$, то случай $r = 0$ можно не оговаривать.

Например,

1. Для $A = \mathbb{Z}$: $N(a) = |a|$.
2. $A = K[x]$: $N(f) = \deg f$.
3. Кольцо гауссовых целых чисел $\mathbb{Z}[i] = \{x + i \cdot y \mid x, y \in \mathbb{Z}\}$, $N(z) = |z|^2$.



Теорема. В евклидовом кольце $\forall a, b \neq 0 \exists \gcd(a, b)$.

Доказательство. \square Алгоритм Евклида:

1. Делим с остатком: $a = b \cdot q_1 + r_1$. Если $r_1 = 0$, то конец. Иначе переходим на шаг 2.
2. $b = r_1 \cdot q_2 + r_2$
3. $r_1 = r_2 \cdot q_3 + r_3$
- \vdots
- $(k+1) \cdot r_{k-1} = r_k \cdot q_{k+1} + r_{k+1}$.
- \vdots
- $(s-1) \cdot r_{s-1} = r_s \cdot q_{s+1}$.

Этот алгоритм конечен, поскольку $N(b) > N(r_1) > N(r_2) > \dots > N(r_{k+1})$ и все нормы целые неотрицательные, значит спуск не может быть бесконечным!

Тогда $r_{s-1} = \gcd(a, b)$. Действительно,

1. $r_s | r_{s-1} \Rightarrow r_s | r_{s-2} \Rightarrow \dots \Rightarrow r_s | r_{k+1}, r_k \Rightarrow r_s | r_{k-1} \Rightarrow \dots \Rightarrow r_s | r_2, r_1 \Rightarrow r_s | b \Rightarrow r_s | a$.
2. $c | a, b \Rightarrow c | r_1 = a - b \cdot q_1 \Rightarrow c | r_2 = b - r_1 \cdot q_2 \Rightarrow \dots \Rightarrow c | r_{k-1}, r_k \Rightarrow c | r_{k+1} \Rightarrow \dots \Rightarrow c | r_s$.

Поэтому оба свойства НОД выполнены. ■

 Следствие алгоритма Евклида. $\gcd(a, b) = u \cdot a + v \cdot b$, где $u, v \in A$ – элементы того же евклидова кольца.

Доказательство □ Докажем, что $r_k = u_k \cdot a + v_k \cdot b$.

Индукция по k .

1. $k = 1$: $r_1 = 1 \cdot a - q_1 \cdot b$.
2. Шаг: $r_{k+1} = r_{k-1} - r_k \cdot q_{k+1} = u_{k-1} \cdot a + v_{k-1} \cdot b - (u_k \cdot a + v_k \cdot b) = (u_{k-1} - u_k \cdot q_{k+1}) \cdot a + (v_{k-1} - v_k \cdot q_{k+1}) \cdot b$.

При $k = s$ получаем выражение для $r_s = \gcd(a, b)$. ■

A.10.4. Простые элементы и основная теорема арифметики в евклидовом кольце

Определение. Элемент p целостного кольца A называется простым если $p \neq 0, p \notin A^\times$, $\nexists p = a \cdot b$, где $a, b \notin A^\times$.

В кольце многочленов над полем K многочлен $p \in K[x]$ будет простым, если $p \neq 0$, $\deg p > 0$, $\nexists p = f \cdot g$, где $0 < \deg f, \deg g < \deg p$. То есть такие многочлены не разлагаются в произведение двух множителей меньшей степени.

Определение. Простые элементы в $K[x]$ называются неприводимыми многочленами.

Простой элемент $p \in A$ в кольце целостности имеет ровно 2 делителя с точностью до ассоциированности: p и 1.

 *Лемма.* Пусть A – Евклидово кольцо, $p \in A$ – простой элемент. Тогда

$$p \mid a \cdot b \Rightarrow (p \mid a) \vee (p \mid b) \quad (10.2)$$

Доказательство. \square Заметим, что $\gcd(a, p) \mid p \Rightarrow \gcd(a, p) = 1$ или $\gcd(a, p) = p$. Тогда либо $p \mid a$ – ок, либо $\gcd(a, p) = 1$. Но $\gcd(a, p) = u \cdot a + v \cdot p$. Тогда $b = u \cdot a \cdot b + v \cdot p \cdot b$. Вся сумма делится на p , поэтому $p \mid b$. ■

Следствие. $p \mid a_1 \cdot \dots \cdot a_k \Rightarrow \exists i : p \mid a_i$.

\square Индукция по k . ■

 *Основная теорема арифметики.* В евклидовом кольце $A \forall a \in A : a \neq 0, a \notin A^\times \exists$ разложение в произведение простых элементов, причём это разложение единственное с точностью до перестановки и ассоциированности.

Доказательство. \square

1. Существование разложения. Будем доказывать индукцией по $N(a)$.

База: пусть $N(a) = n_0$ – наименьшее значение нормы необратимых элементов кольца A . Отсюда a – простой элемент, так как иначе, если бы $a = b \cdot c$, то $N(b) < a > N(c)$ по монотонности евклидовой нормы, но тогда мы получаем противоречие с тем, что n_0 – наименьшее значение нормы необратимых элементов.

Шаг индукции: Если a прост, то существование разложения доказано. Если он не прост, то его можно разложить в произведение необратимых: $a = b \cdot c$. Так как норма этих множителей меньше, то их можно разложить по предположению индукции: $b = p_1 \cdot \dots \cdot p_m$, $c = p_{m+1} \cdot \dots \cdot p_{m+k}$. Перемножая, получаем разложение для a .

2. Единственность. Пусть у нас есть 2 разных разложения для элемента a :

$$a = p_1 \cdot \dots \cdot p_m = q_1 \cdot \dots \cdot q_n \quad (10.3)$$

НУО, можно считать, что $m \leq n$. Хотим доказать, что $m = n$ и $p_i \sim q_i$, если занумеровать элементы. Докажем индукцией по m .

База: $m = 1 \Rightarrow a$ простой $\Rightarrow n = 1, p_1 = q_1$ — ок.

Шаг: $p_m \mid q_1 \cdot \dots \cdot q_n \Rightarrow \exists i : p_m \mid q_i$. Перенумеруем множители q_i так, чтобы $p_m \mid q_n$. Но так как q_n прост, то $p_m \sim q_n$. То есть $q_n = p_m \cdot u$, где $u \in A^\times$. Отсюда

$$\begin{aligned} p_1 \cdot \dots \cdot p_m &= q_1 \cdot \dots \cdot q_{n-1} \cdot (p_m \cdot u) \Rightarrow \\ &\Rightarrow p_1 \cdot \dots \cdot p_{m-1} = q_1 \cdot \dots \cdot (q_{n-1} \cdot u) \end{aligned} \quad (10.4)$$

то есть мы получили два разложения на простые множители, и в них меньшее количество множителей, причём по предположению индукции $m - 1 = n - 1$, поэтому $m = n$ и после перенумерации $p_1 \sim q_1, \dots, p_{n-1} \sim q_{n-1} \cdot u \sim q_{n-1}$.

 **Следствие 1.** Любое натуральное число единственным способом разлагается в произведение простых множителей. $\forall n \in \mathbb{N} :$

$$n = p_1 \cdot \dots \cdot p_m \quad (10.5)$$

 **Следствие 2.** Любой многочлен $f \in K[x]$, $\deg f > 0$ разлагается в произведение неприводимых многочленов единственным способом с точностью до перестановки множителей и умножения их на ненулевые константы:

$$f = p_1 \cdot \dots \cdot p_m. \quad (10.6)$$

A.10.5. Факториальные кольца

Определение. Целостное кольцо A называется факториальным, если $\forall a \in A : a \neq 0$ и $a \notin A^\times$ его можно единственным способом разложить в произведение простых множителей с точностью до перестановки множителей и их замены на ассоциированные элементы.

Итак, евклидовы кольца факториальные.

В факториальном кольце A , если $a = u \cdot p_1^{k_1} \cdot \dots \cdot p_s^{k_s}$ и $b = v \cdot p_1^{l_1} \cdot \dots \cdot p_s^{l_s}$, где $k_i \geq 0$ и $l_i \geq 0$, то

1. $b \mid a \Leftrightarrow k_i \geq l_i \forall i = 1, \dots, s$
2. $\gcd(a, b) = p_1^{\min(k_1, l_1)} \cdot \dots \cdot p_s^{\min(k_s, l_s)}$

$$3. \text{ lcm}(a, b) = p_1^{\max(k_1, l_1)} \cdot \dots \cdot p_s^{\max(k_s, l_s)}$$

A.11. Линейные операторы

Определение. Линейный оператор \mathcal{A} — это линейное отображение из векторного пространства V в себя: $\mathcal{A} : V \rightarrow V$.

Определение. Матрицей линейного оператора \mathcal{A} в базисе $B = \{e_1, e_2, \dots, e_n\}$ называется матрица A , столбцы которой образованы координатами образов базисных векторов при действии оператора \mathcal{A} :

$$\mathcal{A}e_j = \sum_{i=1}^n a_{ij}e_i, \quad (11.1)$$

где $A = (a_{ij})$.

Если X — вектор-вектор столбец с координатами некоторого вектора x в базисе B , то координаты образа $\mathcal{A}x$ в том же базисе будут заданы вектор-столбцом $Y = AX$.

Переход к новому базису. Пусть

$$(e'_1, e'_2, \dots, e'_n) = (e_1, e_2, \dots, e_n)C, \quad (11.2)$$

тогда матрица линейного оператора \mathcal{A} в новом базисе будет равна

$$A' = C^{-1}AC. \quad (11.3)$$

Определение. Подпространство $U \subset V$ называется инвариантным относительно линейного оператора \mathcal{A} , если для любого вектора $u \in U$ его образ $\mathcal{A}u$ также принадлежит U .

Если $V = U + W$, где U и W — инвариантные подпространства относительно \mathcal{A} , то в базисе, составленном из базисов U и W , матрица оператора \mathcal{A} будет иметь блочно диагональный вид:

$$A = \begin{pmatrix} B & 0 \\ 0 & D \end{pmatrix}, \quad (11.4)$$

где B и D — матрицы ограничения оператора \mathcal{A} на подпространства U и W соответственно в базисах этих подпространств.

A.11.1. Собственные значения и собственные векторы

Определение. Пусть V — векторное пространство над полем K . Собственным вектором линейного оператора \mathcal{A} называется такой ненулевой вектор $v \in V$, что $\exists \lambda \in K$:

$$\mathcal{A}v = \lambda v, \quad (11.5)$$

число λ называется собственным значением оператора \mathcal{A} , соответствующим собственному вектору v .

Для существования собственного вектора и собственного значения необходимо и достаточно, чтобы оператор $\mathcal{A} - \lambda\mathcal{E}$ был вырожден, то есть $\det(\mathcal{A} - \lambda\mathcal{E}) = 0$.

Определение. Многочлен $\chi_{\mathcal{A}}(t)$ называется характеристическим многочленом линейного оператора \mathcal{A} и определяется формулой

$$\chi_{\mathcal{A}}(t) = (-1)^n \det(\mathcal{A} - t\mathcal{E}), \quad (11.6)$$

где $n = \dim V$.

Предложение. Собственные значения линейного оператора \mathcal{A} над полем K являются корнями его характеристического многочлена $\chi_{\mathcal{A}}(t)$ в поле K .

Следствие. Над полем \mathbb{C} любой линейный оператор имеет хотя бы одно собственное значение.

Из формул Виета следует, что сумма собственных значений линейного оператора \mathcal{A} равна $\text{tr } \mathcal{A}$, а произведение собственных значений равно $\det \mathcal{A}$.

Определение. Линейный оператор \mathcal{A} называется диагонализуемым, если существует такой базис векторного пространства V , что матрица оператора \mathcal{A} в этом базисе является диагональной.

A.11.2. Функции от линейного оператора

Определение. Пусть \mathcal{A} – линейный оператор в векторном пространстве V над полем K , $\dim V = n < \infty$, и $f \in K[x]$. Тогда многочлен от линейного оператора $f(\mathcal{A})$ определяется как

$$f(\mathcal{A}) = a_n \mathcal{A}^n + a_{n-1} \mathcal{A}^{n-1} + \dots + a_1 \mathcal{A} + a_0 \mathcal{E}. \quad (11.7)$$

Так как пространство линейных операторов конечномерно, то среди них есть лишь конечное число линейно независимых степеней оператора \mathcal{A} . Поэтому существует такой ненулевой многочлен f , что $f(\mathcal{A}) = 0$.

Определение. Ненулевой многочлен f со свойством $f(\mathcal{A}) = 0$ называется аннулирующим многочленом линейного оператора \mathcal{A} . Если $m_{\mathcal{A}}$ – аннулирующий многочлен минимальной степени, то он называется минимальным многочленом линейного оператора \mathcal{A} .

Лемма. Минимальный многочлен жордановой клетки порядка m с собственным значением λ равен $(t - \lambda)^n$.

Доказательство. \square Пусть \mathcal{A} — линейный оператор, задаваемый жордановой клеткой. Тогда оператор $\mathcal{N} = \mathcal{A} - \lambda\mathcal{E}$ — нельзятивный высоты m , и его минимальный многочлен равен $(t - \lambda)^m$. Следовательно, $m_{\mathcal{A}} = (t - \lambda)^m$. ■

Теорема. Пусть \mathcal{A} — линейный оператор с различными собственными значениями $\lambda_1, \dots, \lambda_s$. Его минимальный многочлен равен

$$m_{\mathcal{A}}(t) = \prod_{i=1}^s (t - \lambda_i)^{m_i}, \quad (11.8)$$

где m_i — наибольшая размерность жордановой клетки, соответствующей собственному значению λ_i в жордановой форме оператора \mathcal{A} .

Следствие. Жорданова форма линейного оператора \mathcal{A} диагональна тогда и только тогда, когда его минимальный многочлен не имеет кратных корней.

Следствие. Если жорданова форма линейного оператора диагональна, то жорданова форма его ограничения $\mathcal{A}|_U$ на любое инвариантное подпространство $U \subset V$ также диагональна.

Доказательство. \square Пусть \mathcal{A} — линейный оператор с диагональной жордановой формой. Минимальный многочлен $m_{\mathcal{A}}$ оператора \mathcal{A} является аннулирующим для $\mathcal{A}|_U$. Поэтому $m_{\mathcal{A}|_U} | m_{\mathcal{A}}$. Следовательно, $m_{\mathcal{A}|_U}$ также не имеет кратных корней, и его жорданова форма диагональна. ■

Следствие (Теорема Гамильтона-Кэли). $f_{\mathcal{A}}(\mathcal{A}) = 0$.

A.11.3. Задачи

WIP

A.12. Билинейные функции и квадратичные формы

Определение. Пусть V – векторное пространство над полем K . Билинейной функцией $\alpha : V \times V \rightarrow K$ называется функция, линейная по каждому из аргументов:

$$\begin{aligned} \alpha(u + v, w) &= \alpha(u, w) + \alpha(v, w), \\ \alpha(u, v + w) &= \alpha(u, v) + \alpha(u, w), \\ \alpha(cu, v) &= c\alpha(u, v), \\ \alpha(u, cv) &= c\alpha(u, v), \end{aligned} \tag{12.1}$$

$$\forall u, v, w \in V, c \in K.$$

Если $\{e_1, \dots, e_n\}$ – базис V , то матрица билинейной функции α в этом базисе определяется как $A = (a_{ij})$, где $a_{ij} = \alpha(e_i, e_j)$, а сама функция выражается в виде

$$\alpha(x, y) = \sum_{i,j} a_{ij} x_i y_j, \tag{12.2}$$

или, используя матричную запись,

$$\alpha(x, y) = x^T A y. \tag{12.3}$$

Определение. Ядром билинейной функции α называется множество

$$\ker \alpha = \{y \in V : \forall x \in V \alpha(x, y) = 0\}. \tag{12.4}$$

Определение. Билинейная функция α называется невыраженной, если $\ker \alpha = \{0\}$. Так как $\dim \ker \alpha = n - \text{rk } A$, то билинейная функция невыраженная тогда и только тогда, когда матрица A невырожденная.

Определение. Билинейная функция α называется симметрической, если $\forall x, y \in V \alpha(x, y) = \alpha(y, x)$, и кососимметрической, если $\forall x, y \in V \alpha(x, y) = -\alpha(y, x)$. Это эквивалентно тому, что матрица A симметрична ($A^T = A$) или кососимметрична ($A^T = -A$) соответственно.

A.12.1. Квадратичные формы

Определение. Пусть V – векторное пространство над полем K и $\text{char } K \neq 2$, а α – симметрическая билинейная функция на V . Квадратичной формой на V называется функция $q : V \rightarrow K$, такая что

$$q(x) = \alpha(x, x). \tag{12.5}$$

Координатная запись квадратичной формы имеет вид

$$q(x) = \sum_{i,j} a_{ij}x_i x_j, \quad (12.6)$$

или в матричной записи

$$q(x) = x^T A x. \quad (12.7)$$

Между квадратичными формами и симметрическими билинейными функциями существует биекция: каждой квадратичной форме соответствует единственная симметрическая билинейная функция по формуле

$$\alpha(x, y) = \frac{q(x + y) - q(x) - q(y)}{2}, \quad (12.8)$$

называемой поляризационной формулой.

Определение. Пусть V – векторное пространство над полем K и $\text{char } K \neq 2$, а α – симметрическая или кососимметрическая билинейная функция на V . Векторы $x, y \in V$ называются ортогональными относительно α , если $\alpha(x, y) = 0$.

Обозначение ортогональности: $x \perp y$.

Очевидно, что $x \perp y \Leftrightarrow y \perp x$.

Определение. Ортогональным дополнением подпространства $U \subseteq V$ относительно билинейной функции α называется множество

$$U^\perp = \{v \in V : \forall u \in U \rightarrow \alpha(u, v) = 0\}. \quad (12.9)$$

В частности, $\ker \alpha = V^\perp$.

Теорема. Если α – невырожденная билинейная функция на V , то для любого подпространства $U \subseteq V$ выполняется $\dim U^\perp = \dim V - \dim U$ и $(U^\perp)^\perp = U$.

Доказательство. \square Если $\{e_1, \dots, e_k\}$ – базис в U , то U^\perp задается однородной СЛУ, в которой все уравнения линейно независимы, так как α невырожденная. Следовательно, $\dim U^\perp = \dim V - \dim U$. Отсюда $\dim (U^\perp)^\perp = \dim V - \dim U^\perp = \dim V - (\dim V - \dim U) = \dim U$ и $(U^\perp)^\perp \subseteq U$. Следовательно, $(U^\perp)^\perp = U$. ■

Определение. Подпространство $U \subseteq V$ называется невырожденным относительно билинейной функции α , если $\ker(\alpha|_U) = \{0\}$.

Теорема. $V = U + U^\perp \Leftrightarrow U$ невырожденно.

Доказательство. \square $\dim U^\perp \geq \dim V - \dim U$, а значит $\dim U + \dim U^\perp \geq \dim V$. Следовательно, $U + U^\perp = V$ тогда и только тогда, когда $\dim U + \dim U^\perp = \dim V$, что эквивалентно $U \cap U^\perp = \{0\}$, что в свою очередь эквивалентно невырожденности U . ■

Определение. Базис $\{e_1, \dots, e_n\}$ называется ортогональным относительно симметрической билинейной функции α , если $\forall i \neq j \alpha(e_i, e_j) = 0$.

В ортогональном базисе матрица билинейной функции имеет диагональный вид, а сама функция и её квадратичная форма записываются как

$$\begin{aligned}\alpha(x, y) &= \sum_{i=1}^n a_{ii} x_i y_i, \\ q(x) &= \sum_{i=1}^n a_{ii} x_i^2.\end{aligned}\tag{12.10}$$

Теорема. Для любой симметрической билинейной функции α существует ортогональный базис.

Доказательство. \square Докажем утверждение индукцией по $n = \dim V$. База $n = 1$ очевидна. Пусть $n > 1$. Если $\alpha \not\equiv 0$, то её квадратичная форма q не тождественно равна нулю. Тогда $\exists e_1 \in V$:

$$\alpha(e_1, e_1) = q(e_1) \neq 0.\tag{12.11}$$

Тогда $V = \langle e_1 \rangle + \langle e_1 \rangle^\perp$. По предположению индукции в $\langle e_1 \rangle^\perp$ существует ортогональный базис $\{e_2, \dots, e_n\}$. Тогда $\{e_1, e_2, \dots, e_n\}$ – искомый ортогональный базис V . ■

A.12.2. Ортогонализация Грама-Шмидта

Пусть $\{e_1, \dots, e_n\}$ – базис пространства V , а A – матрица симметрической билинейной функции α в этом базисе. Пусть A_k – матрица ограничения α на $\langle e_1, \dots, e_k \rangle = V_k$. Обозначим $\delta_k = \det A_k$ угловой минор порядка k матрицы A .

Теорема. Если все угловые миноры $\delta_1, \dots, \delta_n$ матрицы A симметрической билинейной функции α ненулевые, то в V существует единственный ортогональный базис $\{f_1, \dots, f_n\}$ такой, что

$$\begin{aligned}f_i &\in e_i + V_{i-1}, \\ q(f_i) &= \alpha(f_i, f_i) = \frac{\delta_i}{\delta_{i-1}}\end{aligned}\tag{12.12}$$

$$\forall i = 1, \dots, n \text{ (принимая } \delta_0 = 1).$$

Доказательство. \square Индукция по n . Если $n = 1$, то $f_1 = e_1$ и $q(f_1) = \alpha(e_1, e_1) = \frac{\delta_1}{\delta_0}$. Пусть $n > 1$. По предположению индукции в V_{n-1} существует единственный ортогональный базис $\{f_1, \dots, f_{n-1}\}$. Пусть

$$f_n = e_n + \sum_{i=1}^{n-1} \lambda_i f_i \in e_n + V_{n-1}. \quad (12.13)$$

Заметим, что $q(f_i) = \frac{\delta_i}{\delta_{i-1}} \neq 0$ при $i = 1, \dots, n-1$, и поэтому условия ортогональности

$$0 = \alpha(f_n, f_i) = \alpha(e_n, f_i) + \lambda_i q(f_i) \quad (i = 1, \dots, n-1) \quad (12.14)$$

удовлетворяются при подходящем выборе чисел $\lambda_1, \dots, \lambda_{n-1}$, причем эти числа определяются однозначно. Так как $f_n \notin V_{n-1}$, то $\{f_1, \dots, f_n\}$ – базис пространства V .

Остается проверить равенство из условия теоремы при $k = n$. Матрица перехода от базиса $\{e_1, \dots, e_n\}$ к базису $\{f_1, \dots, f_n\}$ является верхней унитреугольной, поэтому её определитель равен 1 и формула из условия показывает, что определитель матрицы функции α не меняется при переходе к базису $\{f_1, \dots, f_n\}$.

Однако в этом базисе матрица функции α диагональна, причем её диагональные элементы равны $q(f_1), \dots, q(f_{n-1}), q(f_n)$. Следовательно,

$$\delta_n = q(f_1) \dots q(f_{n-1}) q(f_n). \quad (12.15)$$

Такое же рассуждение, применённое к ограничению функции α на подпространство V_{n-1} (или по предположению индукции), показывает, что

$$\delta_{n-1} = q(f_1) \dots q(f_{n-1}). \quad (12.16)$$

Отсюда следует, что $q(f_n) = \frac{\delta_n}{\delta_{n-1}}$. ■

Определение. Нормальным видом квадратичной формы q над полем \mathbb{C} в ортогональном базисе $\{f_1, \dots, f_n\}$ называется запись

$$q = x_1^2 + \dots + x_r^2, \quad (12.17)$$

Определение. Нормальным видом квадратичной формы q над полем \mathbb{R} в ортогональном базисе $\{f_1, \dots, f_n\}$ называется запись

$$q = x_1^2 + \dots + x_k^2 - x_{k+1}^2 - \dots - x_{k+l}^2, \quad (12.18)$$

числа k и l называются положительным и отрицательным индексами инерции квадратичной формы q соответственно.

Положительный индекс инерции равен размерности максимального положительного определённого подпространства относительно квадратичной формы q .

Теорема(Закон инерции). Положительный и отрицательный индексы инерции квадратичной формы q над полем \mathbb{R} не зависят от выбора базиса, в котором q имеет нормальный вид.

Метод Якоби. Если все угловые миноры δ_k матрицы вещественной квадратичной формы отличны от нуля, то её отрицательный индекс инерции равен количеству перемен знака в последовательности

$$1, \delta_1, \delta_2, \dots, \delta_n. \quad (12.19)$$

Следствие(критерий Сильвестра). Вещественная квадратичная форма является положительно определённой тогда и только тогда, когда все угловые миноры её матрицы положительны.

A.12.3. Примеры

Пример. Пусть $V = \mathbb{R}^3$ и α – билинейная функция, заданная формулой

$$\alpha(x, y) = x_1y_1 + 2x_2y_2 + 3x_3y_3 + x_1y_2 + x_2y_1. \quad (12.20)$$

Тогда матрица функции α имеет вид

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 1 & 2 & 0 \\ 0 & 0 & 3 \end{pmatrix} \quad (12.21)$$

и её угловые миноры равны $\delta_1 = 1$, $\delta_2 = 1$, $\delta_3 = 3$. По теореме об ортогонализации Грама-Шмидта существует единственный ортогональный базис $\{f_1, f_2, f_3\}$ такой, что

$$\begin{aligned} f_1 &= e_1, \\ f_2 &= e_2 - e_1, \\ f_3 &= e_3, \end{aligned} \quad (12.22)$$

где $\{e_1, e_2, e_3\}$ – стандартный базис \mathbb{R}^3 . В этом базисе квадратичная форма $q(x) = \alpha(x, x)$ имеет вид

$$q(x) = x_1^2 + x_2^2 + 3x_3^2. \quad (12.23)$$

A.12.4. Применение квадратичных форм: классификация конических сечений

Определение. Коническим сечением на плоскости \mathbb{R}^2 называется множество точек, заданное уравнением вида

$$q(x) + 2l(x) + c = 0, \quad (12.24)$$

где q — квадратичная форма на \mathbb{R}^2 , l — линейная форма на \mathbb{R}^2 , $c \in \mathbb{R}$.

A.13. Евклидовы пространства

Определение. Евклидовым пространством называется вещественное векторное пространство с заданной на нём положительно определенной симметрической билинейной функцией, называемой скалярным произведением, и обозначаемой (x, y) для векторов x и y .

Определение. Длиной вектора x называется корень из скалярного квадрата x :

$$|x| := \sqrt{(x, x)}. \quad (13.1)$$

 **Теорема(неравенство Коши-Буняковского).** Для любых векторов x и y евклидова пространства E

$$|(x, y)| \leq |x| \cdot |y|, \quad (13.2)$$

причём равенство имеет место тогда и только тогда, когда x и y линейно зависимы.

Доказательство. \square Если $y = \lambda x$, то $|(x, y)| = |\lambda(x, x)| = |\lambda||x|^2 = |x||y|$. Если это не так, то x и y образуют базис двумерного подпространства, где определитель матрицы умножения положителен

$$\begin{vmatrix} (x, x) & (x, y) \\ (y, x) & (y, y) \end{vmatrix} > 0 \quad (13.3)$$

■

Определение. Косинус угла между векторами x и y определяется как

$$\cos \widehat{xy} := \frac{(x, y)}{|x||y|}. \quad (13.4)$$

Определение. Матрицей Грама системы векторов $\{a_1, \dots, a_n\}$ называется матрица

$$G(a_1, \dots, a_n) := \begin{pmatrix} (a_1, a_1) & (a_1, a_2) & \dots & (a_1, a_n) \\ (a_2, a_1) & (a_2, a_2) & \dots & (a_2, a_n) \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ (a_n, a_1) & (a_n, a_2) & \dots & (a_n, a_n) \end{pmatrix} \quad (13.5)$$

 **Теорема.** Определитель матрицы грама неотрицателен $\forall a_1, \dots, a_n$

$$\deg G(a_1, \dots, a_n) \geq 0, \quad (13.6)$$

и равен нулю тогда и только тогда, когда векторы a_1, \dots, a_n линейно зависимы.

Доказательство.

B. Математический анализ

B.1. Числовые последовательности

Отображение $\mathbb{N} \rightarrow \mathbb{R}$ называется числовой последовательностью. Последовательность можно записать как $a_1, a_2, \dots, a_n, \dots$, где $\forall n \in \mathbb{N} : a_n \in \mathbb{R}$ или же

$$\{a_n\}_{n=1}^{\infty} \quad (14.1)$$

Членом последовательности с номером n называется пара (n, a_n) .

B.1.1. Предел последовательности

Число $a \in \mathbb{R}$ называется пределом последовательности $\{a_n\}$, если

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : |a_n - a| < \varepsilon \quad (14.2)$$

Если a — предел последовательности $\{a_n\}$, то пишут

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = a. \quad (14.3)$$

Можно дать более общее определение, если ввести следующие обозначения.

1. $\overline{\mathbb{R}} = \mathbb{R} \cup \{-\infty, +\infty\}$
2. $\hat{\mathbb{R}} = \overline{\mathbb{R}} \cup \{\infty\}$
3. Понятие эпсилон-окрестности элемента $a \in \hat{\mathbb{R}}$.

3.1. Если $a \in \mathbb{R}$, то

$$u_{\varepsilon}(a) \stackrel{\text{def}}{=} (a - \varepsilon, a + \varepsilon) \quad (14.4)$$

3.1. Если $a = -\infty$, то

$$u_{\varepsilon}(a) \stackrel{\text{def}}{=} \left(-\infty, -\frac{1}{\varepsilon}\right) \quad (14.5)$$

3.2. Если $a = +\infty$, то

$$u_{\varepsilon}(a) \stackrel{\text{def}}{=} \left(\frac{1}{\varepsilon}, +\infty\right) \quad (14.6)$$

3.3. Если $a = \infty$, то

$$u_{\varepsilon}(a) \stackrel{\text{def}}{=} \left(-\infty, -\frac{1}{\varepsilon}\right) \cup \left(\frac{1}{\varepsilon}, +\infty\right) \quad (14.7)$$

Тогда $a \in \hat{\mathbb{R}}$ называется пределом последовательности $\{a_n\}$, если

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : a_n \in u_{\varepsilon}(a) \quad (14.8)$$

B.1.2. Ограниченнность

Последовательность $\{a_n\}$ называется *ограниченной сверху*, если $\exists M \in \mathbb{R} : \forall n \in \mathbb{N} : a_n \leq M$.

Последовательность $\{a_n\}$ называется *ограниченной снизу*, если $\exists m \in \mathbb{R} : \forall n \in \mathbb{N} : a_n \geq m$.

Последовательность $\{a_n\}$ называется *ограниченной*, если она ограничена сверху и снизу.

Теорема. Если последовательность $\{a_n\}$ сходится, то она ограничена.

Доказательство. \square Пусть $a_n \rightarrow a$. По определению сходимости $\forall \varepsilon > 0 \exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : |a_n - a| < \varepsilon$. В частности, для $\varepsilon = 1$:

$$\exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : |a_n - a| < 1. \quad (14.9)$$

Тогда вне 1-окрестности числа a лежит конечное число членов a_n , поэтому мы можем явно предъявить ограничивающие сверху и снизу константы M и m соответственно:

$$M = \max(\{a_n \mid n \leq N\} \cup \{a + 1\}) \quad (14.10)$$

$$m = \min(\{a_n \mid n \leq N\} \cup \{a - 1\}) \quad (14.11)$$

Поэтому последовательность ограничена сверху и снизу, и поэтому она ограничена. \blacksquare

Контрпример для обратного утверждения(ограничена \Rightarrow сходится?): последовательность $a_n = (-1)^n$ не сходится, но ограничена.

B.1.3. Единственность предела

Лемма. Если $a, b \in \overline{\mathbb{R}}$ и $a \neq b$, то

$$\exists \varepsilon > 0 : u_\varepsilon(a) \cap u_\varepsilon(b) = \emptyset \quad (14.12)$$

Доказательство: \square Не умоляя общности рассуждений, предположим, что $a < b$.

1. Пусть $a, b \in \mathbb{R}$. Возьмём $\varepsilon = \frac{b-a}{3} \Rightarrow \forall x \in u_\varepsilon(a), y \in u_\varepsilon(b) :$

$$x < a + \varepsilon < b - \varepsilon < y \quad (14.13)$$

2. $a = -\infty, b \in \mathbb{R}$.

$$b - \varepsilon > -\frac{1}{\varepsilon} \Leftrightarrow b > -\varepsilon^2 + b\varepsilon > -1 \quad (14.14)$$

$$\varepsilon^2 - b\varepsilon - 1 < 0 \quad (14.15)$$

Это неравенство всегда имеет *положительное* решение относительно ε , поскольку дискриминант квадратного трёхчлена в левой части всегда положителен, а по теореме Виета, произведение корней отрицательно, а значит больший корень положителен.

3. $b = +\infty, a \in \mathbb{R}$.

$$a + \varepsilon < \frac{1}{\varepsilon} \Leftrightarrow a < \varepsilon^2 + a\varepsilon < 1 \quad (14.16)$$

$$\varepsilon^2 + a\varepsilon - 1 > 0 \quad (14.17)$$

Это неравенство всегда имеет *положительное* решение относительно ε .

4. $a = -\infty, b = +\infty$. В этом случае $\forall \varepsilon > 0$

$$-\frac{1}{\varepsilon} < 0 < \frac{1}{\varepsilon} \quad (14.18)$$

Поэтому $\forall x \in u_\varepsilon(a), y \in u_\varepsilon(b) : x < 0 < y$.

В случаях 2 и 3 показано, что для любого действительного числа существует подходящее значение ε , при котором любое число из его окрестности заведомо больше или меньше соответственно любого числа из окрестности $-\infty$ или $+\infty$. ■

Из вышепоказанной леммы можно получить такую теорему.

Теорема. У любой последовательности $\{a_n\}$, сходящейся в $\overline{\mathbb{R}}$ может быть только один предел.

B.1.4. Свойства пределов, связанные с неравенствами

Выведем некоторые свойства пределов.

1. Пусть $a, b \in \mathbb{R}$. Тогда верно следующее(знак $<$ можно заменить на $>$).

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = a < b \Rightarrow \exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : a_n < b. \quad (14.19)$$

Доказательство. □ Пусть $\lim a_n = a < b$. По определению предела $\forall \varepsilon > 0 \exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : |a_n - a| < \varepsilon$. В частности, для $\varepsilon = \frac{b-a}{2}$:

$$\exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : |a_n - a| < \varepsilon. \quad (14.20)$$

Следовательно, $\forall n > N : a_n < a + \varepsilon = a + \frac{b-a}{2} = \frac{a+b}{2} < b$. ■

2. Пусть $\lim a_n = a$.

$$\exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : a_n \leq b \Rightarrow a \leq b. \quad (14.21)$$

Доказательство. \square Предположим, что

$$[\exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : a_n \leq b] \wedge \neg(a \leq b) \quad (14.22)$$

Поскольку тогда $a > b$, то по свойству 1, начиная с некоторого номера, $a_n > b$, но по предположению $a_n \leq b$. Это противоречие. ■

3. Теорема о промежуточной последовательности(о двух милиционерах).

Пусть даны три последовательности a_n, b_n, c_n , такие что $\exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : a_n \leq b_n \leq c_n$. Тогда

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = \lim_{n \rightarrow \infty} c_n = a \in \overline{\mathbb{R}} \Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} b_n = a \quad (14.23)$$

Доказательство. \square Пусть $\lim a_n = a, \lim c_n = a$. Тогда по определению предела

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N_1 \in \mathbb{N} : \forall n > N_1 : a_n \in u_\varepsilon(a) \quad (14.24)$$

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N_2 \in \mathbb{N} : \forall n > N_2 : c_n \in u_\varepsilon(a). \quad (14.25)$$

Тогда $\exists N_3 = \max\{N_1, N_2, N\}$ (N из условия теоремы, то есть тот номер, начиная с которого верно неравенство). Имеем $\forall n > N_3$:

$$u_\varepsilon(a) \ni a_n \leq b_n \leq c_n \in u_\varepsilon(a) \quad (14.26)$$

Поэтому $\forall n > N_3 : b_n \in u_\varepsilon(a)$, а это и есть определение предела $\lim b_n = a$. ■

B.1.5. Бесконечно малые последовательности

Определение. Последовательность α_n называется бесконечно малой(БМ), если

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \alpha_n = 0 \quad (14.27)$$

Свойства бесконечно малых последовательностей:

- Если α_n и β_n - бесконечно малые последовательности, то $\alpha_n + \beta_n$ - бесконечно малая последовательность.

Доказательство. \square Пусть $\lim \alpha_n = 0, \lim \beta_n = 0$. Тогда по определению предела

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N_1 \in \mathbb{N} : \forall n > N_1 : |\alpha_n| < \varepsilon \quad (14.28)$$

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N_2 \in \mathbb{N} : \forall n > N_2 : |\beta_n| < \varepsilon. \quad (14.29)$$

Обозначим $N = \max\{N_1, N_2\}$. Тогда $\forall n > N : |\alpha_n + \beta_n| \leq |\alpha_n| + |\beta_n| < 2\varepsilon$, что и означает, что $\lim(\alpha_n + \beta_n) = 0$. ■

2. Если α_n - бесконечно малая последовательность, а a_n - ограничена, то $\alpha_n \cdot a_n$ – бесконечно малая последовательность.

Доказательство. □ Пусть $\lim \alpha_n = 0$, a_n ограничена, то есть $\exists M > 0 : \forall n \in \mathbb{N} : |a_n| < M$. Тогда для последовательности $\beta_n = \alpha_n \cdot a_n$ имеем

$$|\beta_n| = |\alpha_n| \cdot |a_n| \underset{(n>N)}{<} \varepsilon \cdot M. \quad (14.30)$$

Тогда b_n - бесконечно малая последовательность. ■

Утверждение. Если α_n – бесконечно малая последовательность, то

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = a \Leftrightarrow \exists \alpha_n = a_n - a \quad (14.31)$$

Доказательство. □

1. \Rightarrow . По определению предела

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : |a_n - a| < \varepsilon. \quad (14.32)$$

Обозначим $\alpha_n = a_n - a$. Тогда $\forall n > N : |\alpha_n| < \varepsilon$, следовательно, $\lim \alpha_n = 0$.

2. \Leftarrow . По определению бесконечно малой последовательности,

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : |\alpha_n| < \varepsilon. \quad (14.33)$$

Подставляя сюда $\alpha_n = a_n - a$, получаем, что $a_n \rightarrow a$.

■

B.1.6. Арифметические свойства пределов

Сначала докажем лемму о сохранении знака.

Лемма о сохранении знака. Пусть $\lim b_n = b \neq 0$. Тогда $\exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N :$

$$\left[|b_n| > \frac{|b|}{2} \right] \wedge [\text{sign}(b_n) = \text{sign}(b)] \quad (14.34)$$

Доказательство. □ В определении предела для b_n мы возьмём $\varepsilon = \frac{|b|}{2}$. Для $b > 0$ получим $\exists N \in \mathbb{N} : \forall n > N : |b_n - b| < \frac{|b|}{2}$, что эквивалентно

$$-\frac{b}{2} < b_n - b < \frac{b}{2} \Rightarrow b_n > \frac{b}{2} > 0 \quad (14.35)$$

Отсюда следует требуемое. Если $b < 0$, то аналогично получаем $b_n < -\frac{b}{2} < 0$. ■

После доказательства леммы о сохранении знака можно перейти к теореме об арифметических свойствах пределов.

Теорема. Пусть $\lim a_n = a$, $\lim b_n = b$, тогда

$$1. \quad \exists \lim_{n \rightarrow \infty} (a_n + b_n) = a + b \quad (14.36)$$

$$2. \quad \exists \lim_{n \rightarrow \infty} (a_n - b_n) = a - b \quad (14.37)$$

$$3. \quad \exists \lim_{n \rightarrow \infty} (a_n \cdot b_n) = a \cdot b \quad (14.38)$$

4. Если $b \neq 0$ и $\forall n \in \mathbb{N} : b_n \neq 0$, то

$$\exists \lim_{n \rightarrow \infty} \left(\frac{a_n}{b_n} \right) = \frac{a}{b} \quad (14.39)$$

Доказательство. \square Докажем последовательно все 4 утверждения. Общий план состоит в том, чтобы доказывать, что разность последовательности и её предполагаемого предела — бесконечно малая последовательность. Обозначим $\alpha_n = a_n - a$, а также $\beta_n = b_n - b$.

1. $a_n + b_n - (a + b) = (a_n - a) + (b_n - b) = \alpha_n + \beta_n$ — это сумма двух бесконечно малых последовательностей, следовательно, такая последовательность сама БМ, следовательно $\lim(a_n + b_n) = a + b$.
2. $a_n - b_n - (a - b) = (a_n - a) - (b_n - b) = \alpha_n - \beta_n$. Разность двух БМ также бесконечно малая: легко установить, что если b_n — бесконечно малая последовательность, то $(-b_n)$ — тоже БМ. Итак, мы получили разность двух бесконечно малых последовательностей, следовательно, такая последовательность сама БМ, следовательно $\lim(a_n - b_n) = a - b$.
3. $a_n \cdot b_n - a \cdot b = a_n \cdot b_n - (a \cdot b) \underbrace{+ a_n \cdot b - a_n \cdot b}_{\text{добавили } 0} = b \cdot (a_n - a) + a_n \cdot (b_n - b) = b \cdot \alpha_n + a_n \cdot \beta_n$. Получили сумму двух бесконечно малых, поскольку каждое слагаемое это произведение ограниченной на бесконечно малую (a_n ограничена, так как сходится!). Значит $a_n \cdot b_n - a \cdot b$ — бесконечно малая последовательность, следовательно $\lim(a_n \cdot b_n) = a \cdot b$.
4. Для частного оценим модуль разности последовательности и значения предела.

$$\begin{aligned}
\left| \frac{a_n}{b_n} - \frac{a}{b} \right| &= \left| \frac{a_n \cdot b - a \cdot b_n}{b_n \cdot b} \right| = \left| \frac{a_n \cdot b - a \cdot b + a \cdot b - a \cdot b_n}{b_n \cdot b} \right| = \\
&= \left| \frac{b \cdot \alpha_n - a \cdot \beta_n}{b_n \cdot b} \right| \underset{\substack{\text{лемма о} \\ \text{сокр. знака}}}{<} \frac{|b \cdot \alpha_n - a \cdot \beta_n|}{\frac{|b|^2}{2}}
\end{aligned} \tag{14.40}$$

Для наглядности напишем полученное выражение и посмотрим, что вышло:

$$\left| \frac{a_n}{b_n} - \frac{a}{b} \right| < \underbrace{\frac{2}{b^2}}_{\text{огр.}} \cdot \underbrace{(b \cdot \alpha_n - a \cdot \beta_n)}_{\text{бесконечно малая}} \tag{14.41}$$

Последовательность, которая по модулю асимптотически меньше бесконечно малой, сама является бесконечно малой, следовательно $\lim\left(\frac{a_n}{b_n}\right) = \frac{a}{b}$.

Таким образом, теорема доказана. ■

B.1.7. Монотонные последовательности

Последовательность $\{a_n\}$ называется *возрастающей*, если $\forall n \in \mathbb{N} : a_{n+1} \geq a_n$.

Последовательность $\{a_n\}$ называется *строго возрастающей*, если $\forall n \in \mathbb{N} : a_{n+1} > a_n$.

Последовательность $\{a_n\}$ называется *убывающей*, если $\forall n \in \mathbb{N} : a_{n+1} \leq a_n$.

Последовательность $\{a_n\}$ называется *строго убывающей*, если $\forall n \in \mathbb{N} : a_{n+1} < a_n$.

Для обозначения возрастания последовательности $\{a_n\}$ будем писать $a_n \uparrow$, а для убывания $a_n \downarrow$.

B.1.7.1. Теорема Вейерштрасса

Теорема. Если последовательность возрастает, то у неё есть предел в $\bar{\mathbb{R}}$, а точнее

1. Если последовательность возрастает и ограничена сверху, то у неё есть предел \mathbb{R} .
2. Если последовательность возрастает и не ограничена сверху, то она сходится к $+\infty$.

Доказательство. □ Рассмотрим последовательность $x_n \uparrow$ и положим $a = \sup(x_n)$.

Тогда мы можем записать, что

$$\forall n \in \mathbb{N} : x_n \leq a \tag{14.42}$$

(по определению точной верхней грани). А также

$$\forall \varepsilon > 0 \exists n_\varepsilon : x_{n_\varepsilon} \in u_\varepsilon(a) \tag{14.43}$$

Теперь по определению возрастающей последовательности $\forall \varepsilon > 0 \exists n_\varepsilon \in \mathbb{N} :$

$$\forall n > n_\varepsilon : x_n \geq x_{n_\varepsilon} \quad (14.44)$$

Получили двойное неравенство $\forall n > n_\varepsilon :$

$$x_{n_\varepsilon} \leq x_n \leq a \quad (14.45)$$

Значит, начиная с некоторого номера, все x_n лежат в ε -окрестности a . Что и требовалось доказать. ■

Абсолютно аналогично можно доказать, что если последовательность убывает и ограничена снизу, то у неё есть предел.

B.1.8. Кто растёт быстрее?

Пусть $k \in \mathbb{N}$ и $q > 1$. Рассмотрим 4 последовательности:

$$n^k, q^n, n!, n^n \quad (14.46)$$

- Сравнение степенной и показательной последовательности. Рассмотрим последовательность

$$x_n = \frac{n^k}{q^n} \quad (14.47)$$

$$x_{n+1} = \frac{(n+1)^k}{q^{n+1}} \quad (14.48)$$

Рассмотрим отношение соседних членов:

$$\frac{x_{n+1}}{x_n} = \frac{\left(\frac{n+1}{n}\right)^k}{q} \quad (14.49)$$

Поскольку $\left(\frac{n+1}{n}\right)^k \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} 1 < q$, то начиная с некоторого номера N , $\forall n > N$: $\left(\frac{n+1}{n}\right)^k < q$, поэтому начиная с этого номера $\frac{x_{n+1}}{x_n} < 1$, а значит последовательность $\{x_n\}$ убывает, начиная с этого номера.

Кроме того, последовательность $\{x_n\}$ ограничена снизу нулём: $x_n > 0 \forall n \in \mathbb{N}$. По теореме Вейерштрасса, последовательность x_n имеет предел.

Пусть $\lim x_n = a$. Тогда $\lim x_{n+1} = a$. Предположим, что $a \neq 0$. Тогда

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \left(\frac{x_{n+1}}{x_n} \right) = \frac{a}{a} = 1 \quad (14.50)$$

Но с другой стороны

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \left(\frac{x_{n+1}}{x_n} \right) = \lim_{n \rightarrow \infty} = \frac{\left(\frac{n+1}{n} \right)^k}{q} = \frac{1}{q} \neq 1 \quad (14.51)$$

Получили противоречие $\Rightarrow a = 0$. Итак,

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

2. Сравним $n!$ и q^n . Рассмотрим последовательность $x_n = \frac{q^n}{n!}$. Тогда следующий член равен

$$x_{n+1} = \frac{q^{n+1}}{(n+1)!} \quad (14.52)$$

$$\frac{x_{n+1}}{x_n} = \frac{q}{n+1} < \underset{\substack{\uparrow \\ \text{с некоторого} \\ \text{номера}}}{1} \quad (14.53)$$

Поэтому последовательность x_n , начиная с некоторого номера, убывает. Кроме того, она ограничена снизу нулём. Поэтому пусть $a = \lim x_n = \lim x_{n+1}$. Предположим, что $a \neq 0$. Тогда $\lim \left(\frac{x_{n+1}}{x_n} \right) = 1$, но это противоречит тому, что

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \left(\frac{x_{n+1}}{x_n} \right) = \lim_{n \rightarrow \infty} \left(\frac{q}{n+1} \right) = 0. \quad (14.54)$$

В силу противоречия, $a = 0$, поэтому доказано, что

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

3. Сравним $n!$ и n^n . Рассмотрим последовательность $x_n = \frac{n!}{n^n}$. Найдем отношение соседних членов:

$$x_{n+1} = \frac{(n+1)!}{(n+1)^{n+1}} \quad (14.55)$$

$$\frac{x_{n+1}}{x_n} = \frac{n+1}{\frac{(n+1)^{n+1}}{n^n}} = \frac{1}{\left(1 + \frac{1}{n}\right)^n} \leq 1 \quad (14.56)$$

Значит последовательность x_n убывает и ограничена снизу нулём. Пусть $a = \lim x_n = \lim x_{n+1}$. Предположив, что $a \neq 0$ получим

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{x_{n+1}}{x_n} = 1 \quad (14.57)$$

С другой стороны,

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{x_{n+1}}{x_n} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{\left(1 + \frac{1}{n}\right)^n} = \frac{1}{e} < 1. \quad (14.58)$$

В силу противоречия получаем $a = 0$ и доказываем

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{n!}{n^n} = 0$$

Получили «иерархию роста»: $x^k \rightarrow q^n \rightarrow n! \rightarrow n^n$. В последнем утверждении было использовано число e .

B.1.9. Число e

Определение. Числом e называется следующий предел последовательности

$$e = \lim_{n \rightarrow \infty} \left(1 + \frac{1}{n}\right)^n \quad (14.59)$$

B.1.9.1. Первое доказательство существования e

□ Рассмотрим последовательность $x_n = \left(1 + \frac{1}{n}\right)^{n+1}$. Согласно неравенству Бернулли:

$$x_n = \left(1 + \frac{1}{n}\right)^{n+1} \geq 1 + \frac{n+1}{n} > 2 \quad (14.60)$$

То есть последовательность x_n ограничена снизу. Теперь посмотрим на отношение соседних членов:

$$\begin{aligned} \frac{x_{n+1}}{x_n} &= \frac{\left(1 + \frac{1}{n+1}\right)^{n+2}}{\left(1 + \frac{1}{n}\right)^{n+1}} = \frac{\left(\frac{n+2}{n+1}\right)^{n+2}}{\left(\frac{n+1}{n}\right)^{n+1}} = \\ &= \frac{n+2}{n+1} \cdot \left(\frac{n^2 + 2n}{(n+1)^2}\right)^{n+1} \end{aligned} \quad (14.61)$$

Оценим величину, обратную ко второму множителю по неравенству Бернулли:

$$\left(\frac{n^2 + 2n + 1}{n^2 + 2n}\right)^{n+1} = \left(1 + \frac{1}{n^2 + 2n}\right)^{n+1} \geq 1 + \frac{n+1}{n^2 + 2n} \quad (14.62)$$

То есть

$$\left(\frac{n^2 + 2n + 1}{n^2 + 2n}\right)^{n+1} \geq \frac{n^2 + 3n + 1}{n^2 + 2n} \quad (14.63)$$

Перевернём это неравенство:

$$\left(\frac{n^2 + 2n}{n^2 + 2n + 1} \right)^{n+1} \leq \frac{n^2 + 2n}{n^2 + 3n + 1} \quad (14.64)$$

Получаем оценку для отношения соседних членов:

$$\frac{x_{n+1}}{x_n} \leq \frac{n+2}{n+1} \cdot \frac{n^2 + 2n}{n^2 + 3n + 1} = \frac{n^3 + 4n^2 + 4n}{n^3 + 4n^2 + 4n + 1} < 1 \quad (14.65)$$

Итак, мы доказали, что последовательность x_n убывает и ограничена снизу числом 2, поэтому по теореме Вейерштрасса у неё есть предел

$$e = \lim_{n \rightarrow \infty} \left(1 + \frac{1}{n}\right)^{n+1} = \lim_{n \rightarrow \infty} \left(1 + \frac{1}{n}\right)^n \quad (14.66)$$

И в силу последнего равенства, этот же предел есть у исходной последовательности из определения числа e . ■

B.1.9.2. Второе доказательство существования e

□ Будем исследовать последовательность $a_n = \left(1 + \frac{1}{n}\right)^n$ напрямую. Согласно биномию Ньютона:

$$a_n = \sum_{k=0}^n C_n^k \left(\frac{1}{n}\right)^k = 1 + C_n^1 \cdot \frac{1}{n} + \dots + C_n^n \cdot \frac{1}{n^n} \quad (14.67)$$

$$a_{n+1} = \sum_{k=0}^{n+1} C_{n+1}^k \left(\frac{1}{n+1}\right)^k = 1 + C_{n+1}^1 \cdot \frac{1}{n+1} + \dots + C_{n+1}^{n+1} \cdot \frac{1}{(n+1)^{n+1}} \quad (14.68)$$

Сравним k — е слагаемые в этих двух суммах, имея в виду, что

$$C_n^k = \frac{n!}{k!(n-k)!} = \frac{(n-k+1) \cdot \dots \cdot n}{k!}. \quad (14.69)$$

$$\begin{aligned} C_n^k \cdot \frac{1}{n^k} &= \frac{1}{k!} \cdot \frac{n-k+1}{n} \cdot \frac{n-k+2}{n} \cdot \dots \cdot \frac{n}{n} \leq \\ &\leq \frac{1}{k!} \cdot \frac{n-k+2}{n+1} \cdot \frac{n-k+3}{n+1} \cdot \dots \cdot \frac{n+1}{n+1} = C_{n+1}^k \cdot \frac{1}{(n+1)^k} \end{aligned} \quad (14.70)$$

Следовательно, $a_{n+1} \geq a_n$, так как каждое слагаемое в a_{n+1} не меньше соответствующего слагаемого в a_n . Таким образом, последовательность a_n возрастает. Теперь докажем, что она ограничена сверху:

$$a_n = \sum_{k=0}^n C_n^k \cdot \frac{1}{n^k} = 1 + 1 + \frac{n(n-1)}{2} \cdot \frac{1}{n^2} + \frac{n(n-1)(n-2)}{6} \cdot \frac{1}{n^3} + \dots$$

$$+ \frac{1}{n^n} \leq 2 + \frac{1}{2!} + \frac{1}{3!} + \frac{1}{4!} + \dots + \frac{1}{n!} \leq 2 + \frac{1}{2} + \frac{1}{2^2} + \frac{1}{2^3} + \dots + \frac{1}{2^{n-1}}$$
(14.71)

Мы смогли оценить a_n сверху суммой двойки и геометрической прогрессии, которая точно меньше 1. Поэтому получаем:

$$a_n < 3 \quad (14.72)$$

По теореме Вейерштрасса, возрастающая ограниченная сверху последовательность имеет предел. Обозначим его e . ■

Из этих двух доказательств мы установили, что

$$2 < e < 3 \quad (14.73)$$

B.1.10. Подпоследовательность

Определение 1. Пусть задана последовательность $\{x_n\}$. Возьмём возрастающую последовательность натуральных чисел: $\{n_k\} \uparrow$ и $n_k \in \mathbb{N} \forall k \in \mathbb{N}$. Тогда последовательность $\{x_{n_k}\}$ называется подпоследовательностью последовательности $\{x_n\}$.

Определение 2. Число a называется частичным пределом последовательности $\{x_n\}$, если существует такая подпоследовательность $\{x_{n_k}\}$, что

$$a = \lim_{k \rightarrow \infty} x_{n_k} \quad (14.74)$$

Определение 2'. Число a называется частичным пределом последовательности $\{x_n\}$, если

$$\forall \varepsilon > 0 \ \forall M \in \mathbb{N} : |\{x_n \mid x_n \in u_\varepsilon(a)\}| > M \quad (14.75)$$

Утверждение. Определения 2 и 2' эквивалентны.

Доказательство. □

1. $2 \Rightarrow 2'$. По определению предела последовательности, $\forall \varepsilon > 0$, начиная с некоторого номера n_k , все члены последовательности будут лежать в ε -окрестности a . Значит, за пределами ε -окрестности лежит только конечное число членов исходной последовательности $\{x_n\}$, что и утверждает $2'$.
2. $2' \Rightarrow 2$. Рассмотрим окрестность точки a с $\varepsilon = 1$. Возьмём произвольный член последовательности x_n с номером n_1 , такой, что $x_{n_1} \in u_\varepsilon(a)$. Теперь рассмотрим более малую окрестность, $\varepsilon = \frac{1}{2}$. Выберем в ней такой x_{n_2} , что $n_2 > n_1$. Далее

аналогично выбираем x_{n_3} в $\frac{1}{3}$ -окрестности a такой, что $n_3 > n_2$, и так далее. То есть, мы строим подпоследовательность

$\{x_{n_k}\}$, такую что

$$a - \frac{1}{k} < x_{n_k} < a + \frac{1}{k} \quad (14.76)$$

При $k \rightarrow \infty$ получаем по теореме о двух милиционерах, что

$$\lim_{k \rightarrow \infty} x_{n_k} = a. \quad (14.77)$$

Что и требовалось доказать. ■

B.1.10.1. Теорема Больцано-Вейерштрасса

Теорема Больцано-Вейерштрасса. Каждая ограниченная последовательность имеет сходящуюся подпоследовательность.

Доказательство. □ Пусть последовательность $\{x_n\}$ ограничена, тогда все члены последовательности лежат на отрезке $[m_1, M_1]$. Если разбить данный отрезок пополам, то хотя бы на одном из них будет бесконечное количество членов $\{x_n\}$. Действительно, если это не так, то на обоих подотрезках лежит конечное число членов, что противоречит ограниченности $\{x_n\}$. Поделим пополам отрезок $[m, M]$ и выберем тот отрезок $[m_2, M_2] \subset [m_1, M_1]$, на котором лежит бесконечное число членов. И так далее, каждый следующий отрезок $[m_k, M_k]$ вложен в предыдущий и имеет в два раза меньшую длину.

Полученная конструкция есть *система стягивающихся отрезков*. По теореме Кантора, у всех этих отрезков есть только одна общая точка. Обозначим её a . Пусть $x_{n_k} \in [m_k, M_k]$, так как на каждом отрезке бесконечно много членов, то последовательность $\{n_k\}$ можно сделать возрастающей.

Для каждого члена подпоследовательности x_{n_k} выполняется неравенство:

$$|x_{n_k} - a| < \frac{M_1 - m_1}{2^{k-1}} \quad (14.78)$$

Что равносильно двойному неравенству:

$$a - \frac{M_1 - m_1}{2^{k-1}} < x_{n_k} < a + \frac{M_1 - m_1}{2^{k-1}} \quad (14.79)$$

При стремлении $k \rightarrow \infty$ получаем по теореме о промежуточной последовательности, что

$$\lim_{k \rightarrow \infty} x_{n_k} = a. \quad (14.80)$$

Таким образом, мы явно построили сходящуюся подпоследовательность ограниченной последовательности и теорема доказана. ■

B.1.11. Критерий Коши сходимости числовых последовательностей

Определение. Последовательность $\{x_n\}$ называется *фундаментальной*, если

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N \in \mathbb{N} : \forall m, n > N : |x_n - x_m| < \varepsilon \quad (14.81)$$

Критерий Коши. Последовательность $\{x_n\}$ сходится тогда и только тогда, когда она является фундаментальной.

Доказательство. □ Докажем каждое утверждение по отдельности.

1. сход. \Rightarrow фунд. По определению предела,

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N \in \mathbb{N} : \forall n \geq N : |x_n - a| < \varepsilon \quad (14.82)$$

Но тогда, начиная с N , для всех $m, n \geq N$, поскольку $x_n, x_m \in u_\varepsilon(a)$, выполняется неравенство

$$|x_n - x_m| < 2\varepsilon, \quad (14.83)$$

что и означает, что последовательность является фундаментальной.

2. фунд. \Rightarrow сход. Сначала докажем, что из фундаментальности следует ограниченность. Пусть $\{x_n\}$ фундаментальна, тогда для фиксированного $\varepsilon > 0$, и любого фиксированного номера $m \geq N$, все члены с номерами $n \geq N$ лежат в интервале $(x_m - \varepsilon, x_m + \varepsilon)$. Поскольку вне интервала лежит только конечное число членов, то последовательность $\{x_n\}$ ограничена.

По теореме Больцано-Вейерштрасса, существует сходящаяся подпоследовательность $\{x_{n_k}\}$, пусть её предел равен a . Тогда

$$\forall \varepsilon > 0 \exists n_\varepsilon \in \mathbb{N} : \forall k \geq n_\varepsilon : |x_{n_k} - a| < \varepsilon \quad (14.84)$$

Возьмём любой член x_m такой, что $m \geq n_\varepsilon$. Мы знаем, что $\forall n \geq \max\{n_\varepsilon, N\}$:

$$|x_n - x_m| < \varepsilon \quad (14.85)$$

В частности и для $n = n_k$. Тогда получаем

$$|x_m - a| \leq |x_{n_k} - a| + |x_{n_k} - x_m| < \varepsilon + \varepsilon = 2\varepsilon \quad (14.86)$$

И это выполняется для любого $\varepsilon > 0$, начиная с некоторого номера для любых m , поэтому последовательность $\{x_n\}$ сходится к a .

■

B.2. Предел функции

Определение. Проколотой ε -окрестностью точки x называется множество

$$\dot{u}_\varepsilon(x) = (x - \varepsilon, x) \cup (x, x + \varepsilon) \quad (15.1)$$

B.2.1. Определение предела по Коши

Пусть функция f определена в некоторой проколотой окрестности точки x : $\dot{u}(x)$.

Определение. Число A называется пределом функции f в точке a , если

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 : \forall x \in \dot{u}_\delta(a) \Rightarrow |f(x) - A| < \varepsilon \quad (15.2)$$

B.2.2. Определение предела по Гейне

Пусть функция f определена в некоторой проколотой окрестности точки x : $\dot{u}(x)$.

Определение. Число A называется пределом функции f в точке a , если

$$\forall \{x_n\} : x_n \in \dot{u}(a) : \lim_{n \rightarrow \infty} x_n = a \Rightarrow \exists \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = A \quad (15.3)$$

B.2.3. Эквивалентность определений Коши и Гейне

Утверждение. Определения предела по Коши и по Гейне эквивалентны.

Доказательство. \square Докажем две импликации:

1. [Коши \Rightarrow Гейне]. Пусть мы знаем, что существует предел по Коши, тогда

$$\lim_{x \rightarrow a} f(x) = A \quad (15.4)$$

есть то же самое, что и

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 : \forall x \in \dot{u}_\delta(a) \Rightarrow |f(x) - A| < \varepsilon \quad (15.5)$$

Запишем, что $x_n \rightarrow a$, если $x_n \in \dot{u}(a)$:

$$\forall \delta > 0 \exists N \in \mathbb{N} : \forall n \geq N : 0 < |x_n - a| < \delta \quad (15.6)$$

Объединяя эти два утверждения, получим, что

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N \in \mathbb{N} : \forall n \geq N : |f(x_n) - A| < \varepsilon \quad (15.7)$$

Итак, мы получили, что если $x_n \in \dot{u}(a)$ и $x_n \rightarrow a$, то $f(x_n) \rightarrow A$, что и требовалось доказать.

2. [Гейне \Rightarrow Коши]. Предположим, что определение по Гейне выполнено, а определение по Коши — нет. Запишем отрицание определения по Коши:

$$\exists \varepsilon > 0 : \forall \delta > 0 : \exists x \in \dot{u}_\delta(a) \Rightarrow |f(x) - A| \geq \varepsilon \quad (15.8)$$

Возьмём $\delta = \frac{1}{n}$:

$$\exists \varepsilon > 0 : \exists x_n : 0 < |x_n - a| < \frac{1}{n} \Rightarrow |f(x_n) - A| \geq \frac{1}{n} \quad (15.9)$$

Из $0 < |x_n - a| < \frac{1}{n}$ по теореме о промежуточной последовательности следует, что $\lim x_n = a$ и $x_n \neq a$. Тогда по определению предела по Гейне получаем, что

$$\lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = A. \quad (15.10)$$

Но, из ((15.9)) мы знаем, что $\exists \varepsilon > 0$, что $|f(x_n) - A| \geq \varepsilon$, что противоречит тому, что $A = \lim f(x_n)$. Следовательно, если верно определение по Коши, то верно определение по Гейне.

Что и требовалось доказать. ■

B.2.4. Теорема о промежуточной функции

Теорема. Пусть функции f, g, h определены в $\dot{U}_\varepsilon(a)$ и $\forall x \in \dot{U}_\varepsilon(a) :$

$$f(x) \leq g(x) \leq h(x) \quad (15.11)$$

и существуют пределы:

$$\lim_{x \rightarrow a} f(x) = \lim_{x \rightarrow a} h(x) = A. \quad (15.12)$$

Тогда

$$\lim_{x \rightarrow a} g(x) = A \quad (15.13)$$

Доказательство. □ Рассмотрим любую последовательность $\{x_n\}$, такую что

$$\forall \{x_n\} : x_n \in \dot{U}_\varepsilon(a) : \lim_{n \rightarrow \infty} x_n = a. \quad (15.14)$$

Определим для неё последовательности:

$$f_n = f(x_n), g_n = g(x_n), h_n = h(x_n). \quad (15.15)$$

Так как функции f и h стремятся к A при стремлении x к a , то по определению предела по Гейне имеем:

$$A = \lim_{n \rightarrow \infty} f_n = \lim_{n \rightarrow \infty} h_n \quad (15.16)$$

В силу неравенства ((15.11)) получаем, что

$$f_n \leq g_n \leq h_n \quad (15.17)$$

И, наконец, по [теореме о промежуточной последовательности](#), получаем, что $g_n \rightarrow A$, что согласно определению предела функции по Гейне, означает

$$\lim_{x \rightarrow a} g(x) = A \quad (15.18)$$

Что и требовалось доказать. ■

B.2.5. Арифметические свойства пределов функции

Теорема. Пусть для функций f и g выполняются условия

$$\lim_{x \rightarrow a} f(x) = A \text{ и } \lim_{x \rightarrow a} g(x) = B \quad (15.19)$$

Тогда

- Предел суммы равен сумме пределов

$$\lim_{x \rightarrow a} (f(x) + g(x)) = A + B \quad (15.20)$$

- Предел произведения равен произведению пределов

$$\lim_{x \rightarrow a} (f(x) \cdot g(x)) = A \cdot B \quad (15.21)$$

- Если $\forall x \in \dot{U}(a) : g(x) \neq 0$ и $B \neq 0$, то предел частного равен частному пределов

$$\lim_{x \rightarrow a} \frac{f(x)}{g(x)} = \frac{A}{B} \quad (15.22)$$

Доказательство: $\square \forall \{x_n\} : x_n \in \dot{U}(a) :$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = a \Rightarrow \exists \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = A \quad (15.23)$$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = a \Rightarrow \exists \lim_{n \rightarrow \infty} g(x_n) = B \quad (15.24)$$

Введём последовательности $f_n = f(x_n)$, $g_n = g(x_n)$ и разберёмся с каждым пунктом.

- Пользуясь тем, что предел суммы последовательностей равен сумме пределов, получаем

$$\lim_{n \rightarrow \infty} (f_n + g_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} f_n + \lim_{n \rightarrow \infty} g_n = A + B \quad (15.25)$$

Но по определению предела по Гейне отсюда получаем, что

$$\lim_{x \rightarrow a} (f(x) + g(x)) = A + B \quad (15.26)$$

- Пользуясь тем, что предел произведения последовательностей равен произведению пределов, получаем

$$\lim_{n \rightarrow \infty} (f_n \cdot g_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} f_n \cdot \lim_{n \rightarrow \infty} g_n = A \cdot B \quad (15.27)$$

Но по определению предела по Гейне отсюда получаем, что

$$\lim_{x \rightarrow a} (f(x) \cdot g(x)) = A \cdot B \quad (15.28)$$

3. Пользуясь тем, что предел частного последовательностей равен частному пределов и $B \neq 0$, получаем

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \left(\frac{f_n}{g_n} \right) = \frac{\lim f_n}{\lim g_n} = \frac{A}{B} \quad (15.29)$$

Но по определению предела по Гейне отсюда получаем, что

$$\lim_{x \rightarrow a} \frac{f(x)}{g(x)} = \frac{A}{B}. \quad (15.30)$$

Что и требовалось доказать. ■

Примечание. Свойство предела разности, аналогичное свойству предела суммы, можно получить либо аналогично, либо применив пункты 1 и 2 теоремы об арифметических свойствах пределов функции.

B.2.6. Критерий Коши существования предела функции

Теорема (критерий Коши). Пусть функция f определена в $\dot{U}(x_0)$, $x_0 \in \overline{\mathbb{R}}$. Предел функции f в точке x_0 существует тогда и только тогда, когда выполняется условие

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists \delta > 0 : \forall x', x'' \in \dot{U}_\delta(x_0) : |f(x') - f(x'')| < \varepsilon. \quad (15.31)$$

Доказательство. □

1. \Rightarrow . Пусть $f(x) \rightarrow A$ при $x \rightarrow x_0$. Запишем дважды определение предела по Коши:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 : \forall x', x'' \in \dot{U}_\delta(x_0) :$$

$$|f(x') - A| < \varepsilon \quad (15.32)$$

$$|f(x'') - A| < \varepsilon \quad (15.33)$$

Отсюда получаем, что

$$|f(x') - f(x'')| \leq |f(x') - A| + |f(x'') - A| < 2\varepsilon \quad (15.34)$$

что и есть условие Коши.

2. \Leftarrow . Пусть мы знаем, что

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists \delta > 0 : \forall x', x'' \in \dot{U}_\delta(x_0) : |f(x') - f(x'')| < \varepsilon. \quad (15.35)$$

Возьмём произвольную последовательность x_n такую, что $\lim x_n = x_0$ и $x_n \in \dot{U}(x_0)$. Тогда по определению предела последовательности

$$\exists N \in \mathbb{N} : \forall n \geq N : x_n \in \dot{U}_\delta(x_0) \quad (15.36)$$

Согласно условию Коши, получаем, что

$$\forall m, n \geq N : |f(x_m) - f(x_n)| < \varepsilon. \quad (15.37)$$

Значит, согласно [критерию Коши сходимости числовых последовательностей](#), мы получаем, что $\{f(x_n)\}$ сходится, пусть

$$A = \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) \quad (15.38)$$

Теперь докажем, что для любой последовательности $\{x_n\} : f(x_n) \rightarrow A$. Предположим противное: пусть для некоторой последовательности $\{x'_n\} : x'_n \in \dot{U}(x_0)$ и $f(x'_n) \rightarrow B \neq A$. Тогда для последовательности $\{x_1, x'_1, x_2, x'_2, \dots\}$ мы получим, что она сходится к x_0 . Рассмотрим последовательность

$$\{f(x_1), f(x'_1), f(x_2), f(x'_2), \dots\} \quad (15.39)$$

Она расходится, поскольку у неё есть два частичных предела A и B , которые не равны друг другу. Но она должна сходиться, поскольку мы доказали выше, что любая такая последовательность сходится. Получили противоречие, значит все последовательности $\{x_n\}$, сходящиеся к x_0 , все члены которых лежат в прошлой окрестности x_0 , имеют один и тот же предел A . Согласно определению предела по Гейне,

$$\lim_{x \rightarrow a} f(x) = A \quad (15.40)$$

Что и требовалось доказать. ■

B.3. Интегрирование

Начнём с некоторых полезных тождеств. Далее считаем, что функции интегрируемы на рассматриваемых отрезках.

1. Если f нечётна, то $\forall a > 0 : \int_{-a}^a f(x)dx = 0$
2. Если f чётна, то $\forall a > 0 : \int_{-a}^a f(x)dx = 2 \int_0^a f(x)dx$
3. **Теорема о среднем:** пусть $a < b$. Тогда $\exists c \in (a, b) :$

$$f(c) = \frac{1}{b-a} \int_a^b f(x)dx \quad (16.1)$$

(очевидно следует из теоремы Лагранжа)

4. **Подстановка:** $\int_a^b f(x)dx = \int_a^b f(a+b-x)dx$.
5. **Дифференцирование по параметру:** Пусть интеграл зависит от параметра α , и пределы интегрирования также являются функциями от α :

$$\begin{aligned} \frac{d}{d\alpha} \int_{\varphi(\alpha)}^{\psi(\alpha)} f(x; \alpha)dx &= f(\psi(\alpha); \alpha) \cdot \psi'(\alpha) - f(\varphi(\alpha); \alpha) \cdot \varphi'(\alpha) + \\ &+ \int_{\varphi(\alpha)}^{\psi(\alpha)} \frac{\partial f}{\partial \alpha} dx \end{aligned} \quad (16.2)$$

6. **Интеграл Фруллани:** Если существуют конечные пределы $f(0)$ и $f(\infty)$, то:

$$\int_0^\infty \frac{f(ax) - f(bx)}{x} dx = (f(\infty) - f(0)) \ln\left(\frac{a}{b}\right) \quad (16.3)$$

B.3.1. Разложение на простейшие дроби

Пусть нам дано поле рациональных дробей $\text{Quot } K[x]$ кольца многочленов $K[x]$.

 **Теорема.** Если правильная дробь $\frac{f}{g} \in \text{Quot } K[x]$ и $g = p_1^{k_1} \cdot p_2^{k_2} \cdot \dots \cdot p_s^{k_s}$ — разложение знаменателя на неприводимые многочлены, то дробь $\frac{f}{g}$ единственным образом можно разложить в сумму рациональных дробей со знаменателями

$$p_1, p_2^2, \dots, p_1^{k_1}, p_2, \dots, p_s^{k_s-1}, p_s^{k_s}. \quad (16.4)$$

Для случая $K = \mathbb{R}$, который нас и интересует, неприводимые многочлены либо линейны, либо квадратичны с корнями из $\mathbb{C} \setminus \mathbb{R}$.

Следствие. Пусть над полем K имеет место $g = (x - c_1)(x - c_2) \dots (x - c_n)$ и все c_i различны, тогда из представления в сумму простейший дробей имеем

$$\frac{f}{g} = \frac{a_1}{x - c_1} + \frac{a_2}{x - c_2} + \dots + \frac{a_n}{x - c_n}, \quad (16.5)$$

откуда при $x = c_i$ получаем

$$f(c_i) = a_i(c_i - c_1) \dots (c_i - c_{i-1})(c_i - c_{i+1}) \dots (c_i - c_n) = a_i \cdot g'(c_i). \quad (16.6)$$

Поэтому коэффициенты a_i можно найти, разделив значение числителя на значение формальной производной знаменателя:

$$a_i = \frac{f(c_i)}{g'(c_i)}. \quad (16.7)$$

В итоге разложение правильной дроби $\frac{f}{g}$ будет выглядеть так:

$$\frac{f}{g} = \sum_{i=1}^n \frac{f(c_i)}{(x - c_i)g'(c_i)}. \quad (16.8)$$

❓ Задачи:

- Пусть $n \in \mathbb{N}$ и $\varepsilon_0, \dots, \varepsilon_{n-1} \in \sqrt[n]{1}$ – корни из единицы. Доказать, что

$$\frac{1}{x^n - 1} = \frac{1}{n} \sum_{i=0}^{n-1} \frac{\varepsilon_i}{x - \varepsilon_i}. \quad (16.9)$$

 *Решение.* □ Согласно следствию из теоремы о разложении правильной дроби, $c_i = \varepsilon_i$, $f(c_i) = 1$, $g'(c_i) = nx^{n-1} \Big|_{x=\varepsilon_i} = n\varepsilon_i^{n-1}$. Поэтому

$$\frac{1}{x^n - 1} = \sum_{i=0}^{n-1} \frac{1}{(x - \varepsilon_i)n\varepsilon_i^{n-1}} = \frac{1}{n} \sum_{i=0}^{n-1} \frac{\varepsilon_i}{x - \varepsilon_i}. \blacksquare \quad (16.10)$$

B.3.2. Интегрирование биномиальных дифференциалов

Следующая теорема Чебышева устанавливает критерий интегрируемости биномиальных дифференциалов в элементарных функциях, и показывает, какой заменой можно свести интеграл к рациональной функции.

Теорема. Интеграл $\int x^m(a + bx^n)^p dx$ выражается в элементарных функциях тогда и только тогда, когда выполняется хотя бы одно из условий:

1. $p \in \mathbb{Z}$.

В этом случае производится замена $t = x^{\frac{1}{r}}$, где r — общий знаменатель дробей m и n .

2. $\frac{m+1}{n} \in \mathbb{Z}$.

В этом случае замена $(b + ax^n) = t^s$, где s — знаменатель дроби $p = \frac{q}{s}$.

3. $\frac{m+1}{n} + p \in \mathbb{Z}$. В этом случае делаем замену $(b + ax^{-n}) = t^s$, где s — знаменатель дроби $p = \frac{q}{s}$

B.3.3. Интегрирование тригонометрических функций

Интеграл $\int R(\sin x, \cos x)dx$ можно в любом случае свести к рациональному с помощью универсальной тригонометрической подстановки:

$$\int R(\sin x, \cos x)dx = \int R\left(\frac{2t}{1+t^2}, \frac{1-t^2}{1+t^2}\right) \frac{2dt}{1+t^2}. \quad (16.11)$$

B.3.4. Использование вычетов

Если у функции f нет изолированных особых точек на \mathbb{R} , то при вычислении интегралов $\int_{-\infty}^{+\infty} f(x)dx$ можно использовать теорему Коши о вычетах в связке со следующими утверждениями:

1. Пусть $f(z)$ регулярна в $\operatorname{Im} z \geq 0$ за исключением n полюсов, не лежащих на $\operatorname{Im} z = 0$. Тогда если $\lim_{z \rightarrow \infty} zf(z) = 0$, то

$$\text{v.p. } \int_{-\infty}^{+\infty} f(x)dx = 2\pi i \sum_{k=1}^n \operatorname{Res}_{z_k} f(z). \quad (16.12)$$

2. Пусть $f(z)$ регулярна в $\operatorname{Im} z \geq 0$ за исключением n полюсов, не лежащих на $\operatorname{Im} z = 0$. Тогда если $\lim_{z \rightarrow \infty} zf(z) = 0$, то $\forall \alpha > 0$

$$\text{v.p. } \int_{-\infty}^{+\infty} f(x)e^{i\alpha x}dx = 2\pi i \sum_{k=1}^n \operatorname{Res}_{z_k} [f(z)e^{i\alpha z}]. \quad (16.13)$$

Здесь v. p. означает главное значение интеграла по Коши: $\lim_{R \rightarrow +\infty} \int_{-R}^R f(x)dx$ и его существование не гарантирует сходимость.

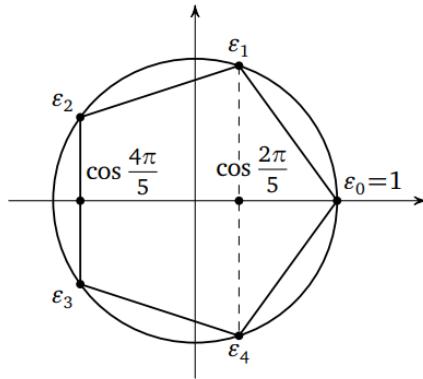
❓ Задачи:

1. Найти интеграл

$$\int_{-\infty}^{+\infty} \frac{dx}{x^4 + x^3 + x^2 + x + 1} = ? \quad (16.14)$$

Решение. \square Пусть $f(z) = \frac{1}{z^4 + z^3 + z^2 + z + 1}$. У этой функции нет особенностей на \mathbb{R} , а корнями знаменателя являются корни из единицы 5 степени кроме самой единицы: $z^4 + z^3 + z^2 + z + 1 = \frac{z^5 - 1}{z - 1}$. В $\operatorname{Im} z > 0$ лежат только корни

$$\begin{aligned} \varepsilon_1 &= \cos\left(\frac{2\pi}{5}\right) + i \sin\left(\frac{2\pi}{5}\right), \\ \varepsilon_2 &= \cos\left(\frac{4\pi}{5}\right) + i \sin\left(\frac{4\pi}{5}\right). \end{aligned} \quad (16.15)$$



По формуле Виета: $\varepsilon_0 + \varepsilon_1 + \dots + \varepsilon_4 = 0$, следовательно, $2 \cos\left(\frac{4\pi}{5}\right) + 2 \cos\left(\frac{2\pi}{5}\right) = 0$. Если $t = \cos\left(\frac{2\pi}{5}\right)$, то $\cos\left(\frac{4\pi}{5}\right) = 2t^2 - 1$. Тогда $4t^2 + 2t - 1 = 0$, значит

$$\begin{aligned} \cos\left(\frac{2\pi}{5}\right) &= \frac{\sqrt{5} - 1}{4}, \\ \cos\left(\frac{4\pi}{5}\right) &= -\frac{\sqrt{5} + 1}{4} \end{aligned} \quad (16.16)$$

Заметим, что $f(z) = \frac{1}{z^4 + z^3 + z^2 + z + 1} = \frac{z-1}{z^5 - 1}$ (так как $z^4 + z^3 + z^2 + z + 1 = \frac{z^5 - 1}{z - 1}$ при $z \neq 1$). Вычет в простом полюсе ε_k :

$$\operatorname{Res}_{\varepsilon_k} f = \lim_{z \rightarrow \varepsilon_k} (z - \varepsilon_k) \frac{z-1}{z^5 - 1} = \frac{\varepsilon_k - 1}{5\varepsilon_k^4} \quad (16.17)$$

Поскольку $\varepsilon_k^5 = 1$, имеем $\varepsilon_k^4 = \frac{1}{\varepsilon_k}$:

$$\operatorname{Res}_{\varepsilon_k} f = (\varepsilon_k - 1) \frac{\varepsilon_k}{5} = \frac{\varepsilon_k^2 - \varepsilon_k}{5} \quad (16.18)$$

По теореме о вычетах:

$$\int_{-\infty}^{+\infty} \frac{dx}{x^4 + x^3 + x^2 + x + 1} = 2\pi i \sum_{k=1}^2 \frac{\varepsilon_k^2 - \varepsilon_k}{5} = \frac{2\pi i}{5} (\varepsilon_1^2 + \varepsilon_2^2 - \varepsilon_1 - \varepsilon_2) \quad (16.19)$$

Имеем $\varepsilon_1 = e^{2\pi i/5} = \cos(\frac{2\pi}{5}) + i \sin(\frac{2\pi}{5})$ и $\varepsilon_2 = e^{4\pi i/5} = \cos(\frac{4\pi}{5}) + i \sin(\frac{4\pi}{5})$.

Тогда:

$$\begin{aligned} \varepsilon_1^2 &= e^{8\pi i/5} = \cos\left(\frac{8\pi}{5}\right) + i \sin\left(\frac{8\pi}{5}\right), \\ \varepsilon_2^2 &= e^{16\pi i/5} = \cos\left(\frac{16\pi}{5}\right) + i \sin\left(\frac{16\pi}{5}\right) = \cos\left(-\frac{2\pi}{5}\right) + \\ &\quad + i \sin\left(-\frac{2\pi}{5}\right) = \cos\left(\frac{2\pi}{5}\right) - i \sin\left(\frac{2\pi}{5}\right) \end{aligned} \quad (16.20)$$

Поэтому:

$$\begin{aligned} \varepsilon_1^2 + \varepsilon_2^2 - \varepsilon_1 - \varepsilon_2 &= \left(\cos\left(\frac{4\pi}{5}\right) + \cos\left(\frac{2\pi}{5}\right) - \cos\left(\frac{2\pi}{5}\right) - \cos\left(\frac{4\pi}{5}\right) \right) + \\ &\quad + i \left(\sin\left(\frac{4\pi}{5}\right) - \sin\left(\frac{2\pi}{5}\right) - \sin\left(\frac{2\pi}{5}\right) - \sin\left(\frac{4\pi}{5}\right) \right) \\ &= i \left(-2 \sin\left(\frac{2\pi}{5}\right) \right) = -2i \sin\left(\frac{2\pi}{5}\right) \end{aligned} \quad (16.21)$$

По теореме о вычетах:

$$\int_{-\infty}^{+\infty} \frac{dx}{x^4 + x^3 + x^2 + x + 1} = \frac{2\pi i}{5} \cdot \left(-2i \sin\left(\frac{2\pi}{5}\right) \right) = \frac{2\pi}{5} \cdot 2 \sin\left(\frac{2\pi}{5}\right) = \frac{4\pi \sin(\frac{2\pi}{5})}{5} \quad (16.22)$$

Найдём $\sin(\frac{2\pi}{5})$ через косинус. Из $\cos(\frac{2\pi}{5}) = \frac{\sqrt{5}-1}{4}$ по основному тригонометрическому тождеству:

$$\sin^2\left(\frac{2\pi}{5}\right) = 1 - \cos^2\left(\frac{2\pi}{5}\right) = 1 - \left(\frac{\sqrt{5}-1}{4}\right)^2 = 1 - \frac{6-2\sqrt{5}}{16} = \frac{10+2\sqrt{5}}{16} \quad (16.23)$$

Поскольку $\sin(\frac{2\pi}{5}) > 0$:

$$\sin\left(\frac{2\pi}{5}\right) = \sqrt{\frac{10 + 2\sqrt{5}}{16}} = \frac{\sqrt{10 + 2\sqrt{5}}}{4} \quad (16.24)$$

Тогда:

$$\int_{-\infty}^{+\infty} \frac{dx}{x^4 + x^3 + x^2 + x + 1} = \frac{4\pi}{5} \cdot \frac{\sqrt{10 + 2\sqrt{5}}}{4} = \frac{\pi\sqrt{10 + 2\sqrt{5}}}{5} \quad (16.25)$$

■

B.4. Кратные интегралы

B.4.1. Двойные интегралы

B.4.1.1. Определение двойного интеграла

Пусть тело (V) в \mathbb{R}^3 ограничено сверху поверхностью $z = f(x, y)$. С боков ограничено цилиндрической поверхностью с образующей, параллельной оси z , а снизу плоской фигурой D на плоскости $z = 0$. Требуется найти объём тела V .

Разобьём D на малые фигуры (σ_i) , $i = 1, \dots, n$. Внутри каждой фигуры рассмотрим точку $(\xi_i, \eta_i) \in \sigma_i$. Тогда объём i -того столбика равен

$$|V_i| = f(\xi_i, \eta_i) \cdot |\sigma_i| \quad (17.1)$$

Приближённо можно написать, что

$$|V| \approx S_n = \sum_{i=1}^n f(\xi_i, \eta_i) \cdot |\sigma_i| \quad (17.2)$$

Полученная сумма называется интегральной. Будем неограниченно увеличивать мощность разбиения: $n \rightarrow \infty$. При стремлении максимального диаметра фигуры σ_i к нулю:

$$\lambda = \max_{i=1, \dots, n} d(\sigma_i) \quad (17.3)$$

получим, что объём $|V|$ равен пределу

$$|V| = \lim_{\lambda \rightarrow 0} \left[\sum_{i=1}^n f(\xi_i, \eta_i) \cdot |\sigma_i| \right] \quad (17.4)$$

Определение. Если существует предел интегральной суммы S_n при стремлении максимального диаметра разбиения области $D \subset \mathbb{R}^2$ к нулю, не зависящий от способа разбиения области, то этот предел называется *двойным интегралом* функции f по области D .

$$\iint_D f(x, y) dx dy \stackrel{\text{def}}{=} \lim_{\lambda \rightarrow 0} \left[\sum_{i=1}^n f(\xi_i, \eta_i) \cdot |\sigma_i| \right] \quad (17.5)$$

Условие существования двойного интеграла. Если функция f непрерывна на ограниченной замкнутой области D , то она интегрируема на D .

B.4.1.2. Суммы Дарбу

Пусть область D разбита на конечное число подмножеств σ_i , $i = 1, \dots, n$. Обозначим

$$M_i = \sup_{\sigma_i} f(x, y) \quad (17.6)$$

$$m_i = \inf_{\sigma_i} f(x, y) \quad (17.7)$$

1. Верхняя сумма Дарбу:

$$S = \sum_{i=1}^n M_i \cdot |\sigma_i| \quad (17.8)$$

2. Нижняя сумма Дарбу:

$$s = \sum_{i=1}^n m_i \cdot |\sigma_i| \quad (17.9)$$

Для любого разбиения справедливо, что

$$s \leq S_n \leq S \quad (17.10)$$

Свойства сумм Дарбу:

- При добавлении новых фигур σ_i и линий в разбиение D нижняя сумма Дарбу не убывает, а верхняя — не возрастает.
- Любая нижняя сумма Дарбу не превосходит любой верхней суммы Дарбу, даже для разных разбиений.

Определение. Колебанием функции $f(x, y)$ на области D называется число

$$S - s = \sum_{i=1}^n (M_i - m_i) \cdot |\sigma_i| \quad (17.11)$$

Критерий интегрируемости Римана. Для того, чтобы ограниченная функция f была интегрируема по области D необходимо и достаточно, чтобы

$$\lim_{\lambda \rightarrow 0} S - s = 0 \quad (17.12)$$

B.4.1.3. Свойства двойного интеграла

Пусть функции $f(x, y)$ и $g(x, y)$ интегрируемы в D .

- Линейность. $\forall \alpha, \beta \in \mathbb{R}$:

$$\iint_D (\alpha f(x, y) + \beta g(x, y)) d\sigma = \alpha \iint_D f(x, y) d\sigma + \beta \iint_D g(x, y) d\sigma \quad (17.13)$$

2. Аддитивность по области. $\forall D_1, D_2 : (D_1 \cup D_2 = D) \wedge (\text{int}(D_1) \cap \text{int}(D_2) = \emptyset) :$

$$\iint_D f(x, y) d\sigma = \iint_{D_1} f(x, y) d\sigma + \iint_{D_2} f(x, y) d\sigma \quad (17.14)$$

3. Интегрирование неравенств. Если $f(x, y) \leq g(x, y)$, то

$$\iint_D f(x, y) d\sigma \leq \iint_D g(x, y) d\sigma \quad (17.15)$$

3.1. Следствие. Если $m \leq f(x, y) \leq M$, то

$$m \cdot |D| \leq \iint_D f(x, y) d\sigma \leq M \cdot |D| \quad (17.16)$$

3.1. Следствие.

$$\left| \iint_D f(x, y) d\sigma \right| \leq \iint_D |f(x, y)| d\sigma \quad (17.17)$$

4. Теорема о среднем. Если функция $f(x, y)$ непрерывна в замкнутой связной области D , то $\exists(\xi, \eta) \in D :$

$$f(\xi, \eta) = \frac{1}{|D|} \iint_D f(x, y) d\sigma \quad (17.18)$$

Доказательство. По теореме Вейерштрасса, на связной замкнутой области D функция f ограничена, поэтому $\exists m, M \in \mathbb{R} : \forall (x, y) \in D : m \leq f(x, y) \leq M$. Используя следствие (3.1), можно написать, что

$$m \leq \frac{1}{|D|} \iint_D f(x, y) d\sigma \leq M \quad (17.19)$$

По теореме Больцано-Коши (о промежуточном значении), непрерывная функция f принимает на D все значения между m и M , в частности $\exists(\xi, \eta) \in D$, для которой выполнено требуемое. ■

5. Интеграл от единицы равен площади области интегрирования.

$$\iint_D dxdy = |D| \quad (17.20)$$

B.4.1.4. Сведение двойного интеграла к повторному

B.4.2. Тройные интегралы

B.4.2.1. Определение тройного интеграла

B.5. Гамма-функция и бета-функция

B.5.1. Гамма-функция

Определение. Гамма-функция $\Gamma(x)$ определяется для всех положительных вещественных чисел $x > 0$ интегралом

$$\Gamma(x) = \int_0^\infty t^{x-1} e^{-t} dt \quad (18.1)$$

B.5.1.1. Свойства гамма-функции

1. Основное свойство гамма-функции.

$$\Gamma(x+1) = x\Gamma(x) \quad (18.2)$$

Доказательство. \square Подставим $(x+1)$ в гамма-функцию:

$$\Gamma(x+1) = \int_0^\infty t^x e^{-t} dt \quad (18.3)$$

Интегрируем по частям:

$$u = t^x \Rightarrow du = xt^{x-1} dt \quad (18.4)$$

$$dv = e^{-t} dt \Rightarrow v = -e^{-t} \quad (18.5)$$

$$\begin{aligned} \int_0^\infty t^x e^{-t} dt &= -t^x e^{-t} \Big|_0^\infty + x \int_0^\infty t^{x-1} e^{-t} dt = \\ &= -\lim_{t \rightarrow \infty} t^x e^{-t} + x \int_0^\infty t^{x-1} e^{-t} dt = 0 + x\Gamma(x) = x\Gamma(x) \end{aligned} \quad (18.6)$$

■

2. Значение гамма-функции в натуральных числах. $\forall n \in \mathbb{N}$

$$\Gamma(n) = (n-1)! \quad (18.7)$$

Доказательство. \square Сначала найдём $\Gamma(1)$:

$$\Gamma(1) = \int_0^\infty t^{1-1} e^{-t} dt = \int_0^\infty e^{-t} dt = -e^{-t} \Big|_0^\infty = 1 \quad (18.8)$$

Используя основное свойство гамма-функции, находим:

$$\Gamma(2) = 1 \cdot \Gamma(1) = 1 = 1! \quad (18.9)$$

$$\Gamma(3) = 2 \cdot \Gamma(2) = 2 = 2! \quad (18.10)$$

Теперь строго обобщим по индукции: пусть верно, что $\Gamma(n) = (n - 1)!$. Докажем, что верно $\Gamma(n + 1) = n!$. По основному свойству гамма-функции: $\Gamma(n + 1) = n\Gamma(n) = n(n - 1)! = n!$. Поскольку база индукции проверена, то требуемое доказано. ■

3. Ещё одно интегральное представление.

$$\Gamma(x) = \int_0^\infty 2t^{2x-1}e^{-t^2}dt \quad (18.11)$$

Доказательство. □ Сделаем в интеграле $\int_0^\infty t^{x-1}e^{-t}dt$ замену:

$$u = \sqrt{t} \Rightarrow \begin{cases} t \rightarrow 0 \Rightarrow u \rightarrow 0 \\ t \rightarrow \infty \Rightarrow u \rightarrow \infty \end{cases} \quad (18.12)$$

$$t = u^2 \Rightarrow dt = 2udu \quad (18.13)$$

$$\int_0^\infty t^{x-1}e^{-t}dt = \int_0^\infty (u^2)^{x-1}e^{-u^2} \cdot 2udu = \int_0^\infty 2u^{2x-1}e^{-u^2}du \quad (18.14)$$

Поскольку $\Gamma(x) = \int_0^\infty t^{x-1}e^{-t}dt$, то требуемое доказано. ■

4. Значения в положительных полуцелых аргументах. $\forall n \in \mathbb{N}_0$:

$$\Gamma\left(n + \frac{1}{2}\right) = \frac{(2n)!}{4^n n!} \sqrt{\pi} \quad (18.15)$$

Доказательство. □ Используем факт ((18.43)) о том, что $\Gamma\left(\frac{1}{2}\right) = \sqrt{\pi}$. Теперь, используя основное свойство гамма-функции, найдём значение в произвольной полуцелой точке:

$$\begin{aligned} \Gamma\left(n + \frac{1}{2}\right) &= \frac{1}{2} \cdot \frac{3}{4} \cdot \dots \cdot \frac{2n - 1}{2} \cdot \Gamma\left(\frac{1}{2}\right) = \\ &= \frac{1 \cdot 3 \cdot \dots \cdot (2n - 1)}{2^n} \cdot \sqrt{\pi} = \frac{(2n - 1)!!}{2^n} \sqrt{\pi} = \frac{(2n)!}{4^n n!} \sqrt{\pi}. \blacksquare \end{aligned} \quad (18.16)$$

5. Свойство дополнения. $\forall x \in (0, 1)$:

$$\Gamma(x) \cdot \Gamma(1 - x) = \frac{\pi}{\sin(\pi x)} \quad (18.17)$$

6. Логарифмическая выпуклость гамма-функции. $\forall x_1, \dots, x_n > 0, \forall \alpha_1, \dots, \alpha_n \in [0, 1], \sum \alpha_i = 1$:

$$\Gamma\left(\sum_{i=1}^n \alpha_i x_i\right) \leq \prod_{i=1}^n [\Gamma(x_i)]^{\alpha_i} \quad (18.18)$$

Доказательство. \square

$$\ln(\Gamma(x)) = \ln\left(\int_0^\infty t^{x-1} e^{-t} dt\right) = \ln\left(\int_0^\infty f(t; x) dt\right) \quad (18.19)$$

$$\frac{d \ln(\Gamma(x))}{dx} = \frac{\Gamma'(x)}{\Gamma(x)} \quad (18.20)$$

$$\frac{d^2 \ln(\Gamma(x))}{dx^2} = \frac{\Gamma''(x) \cdot \Gamma(x) - [\Gamma'(x)]^2}{(\Gamma(x))^2} \quad (18.21)$$

Сейчас мы будем доказывать, что числитель этого выражения положителен для всех $x > 0$.

$$\Gamma'(x) = \int_0^\infty t^{x-1} e^{-t} (\ln t) dt \quad (18.22)$$

$$\Gamma''(x) = \int_0^\infty t^{x-1} e^{-t} (\ln t)^2 dt \quad (18.23)$$

Введём линейно независимые функции f и g на $(0, \infty)$:

$$f(t) = t^{\frac{x-1}{2}} e^{-\frac{t}{2}} \quad (18.24)$$

$$g(t) = t^{\frac{x-1}{2}} e^{-\frac{t}{2}} \ln t \quad (18.25)$$

Запишем неравенство Коши-Буняковского для интегралов:

$$\left[\int_0^\infty f(t)g(t) dt \right]^2 \leq \left(\int_0^\infty f(t)^2 dt \right) \cdot \left(\int_0^\infty g(t)^2 dt \right) \quad (18.26)$$

$$\left[\int_0^\infty t^{x-1} e^{-t} (\ln t) dt \right]^2 \leq \left(\int_0^\infty t^{x-1} e^{-t} dt \right) \cdot \left(\int_0^\infty t^{x-1} e^{-t} (\ln t)^2 dt \right) \quad (18.27)$$

Остаётся заметить, что слева стоит квадрат производной гамма-функции, а справа произведение гамма-функции и её второй производной. Итак, верно неравенство

$$\Gamma''(x) \cdot \Gamma(x) - [\Gamma'(x)]^2 > 0 \quad (18.28)$$

Следовательно, вторая производная логарифма гамма-функции положительна, значит логарифм гамма-функции выпуклая функция, а значит для неё верно неравенство Йенсена. $\forall x_1, \dots, x_n > 0, \forall \alpha_1, \dots, \alpha_n \in [0, 1], \sum \alpha_i = 1$:

$$\ln \left(\Gamma \left(\sum_{i=1}^n \alpha_i x_i \right) \right) \leq \sum_{i=1}^n \alpha_i \ln(\Gamma(x_i)) \quad (18.29)$$

Пользуясь монотонностью экспоненты, получаем исходное неравенство, потенцируя обе части.

$$\Gamma \left(\sum_{i=1}^n \alpha_i x_i \right) \leq \prod_{i=1}^n [\Gamma(x_i)]^{\alpha_i} \quad (18.30)$$

Что и требовалось доказать. ■

B.5.2. Бета-функция

Определение. Бета-функция $B(x, y)$ определяется для всех положительных вещественных чисел $x > 0, y > 0$ интегралом

$$B(x, y) = \int_0^1 t^{x-1} (1-t)^{y-1} dt \quad (18.31)$$

B.5.2.1. Свойства бета-функции

Альтернативное интегральное представление можно получить, если сделать замену $t = \sin^2 u$. Тогда $(1-t) = \cos^2 u$ и $dt = 2 \sin u \cos u$. При $t = 0 \Rightarrow u = 0$ и $t = 1 \Rightarrow u = \frac{\pi}{2}$.

Итак,

$$B(x, y) = \int_0^{\frac{\pi}{2}} 2 \cdot (\sin u)^{2x-1} (\cos u)^{2y-1} du \quad (18.32)$$

Ясно, что бета-функция обладает симметричностью относительно перестановки аргументов, поскольку на $[0, 1]$ графики функций t и $(1-t)$ симметричны относительно $t = \frac{1}{2}$, и значит при транспозиции аргументов значение интеграла не меняется. Ана-

логичный вывод можно получить при анализе тригонометрической интегральной формы.

$$B(x, y) = B(y, x) \quad (18.33)$$

Найдем значение $B\left(\frac{1}{2}, \frac{1}{2}\right)$:

$$B\left(\frac{1}{2}, \frac{1}{2}\right) = \int_0^{\frac{\pi}{2}} 2 \cdot (\sin t)^{2 \cdot \frac{1}{2} - 1} (\cos t)^{2 \cdot \frac{1}{2} - 1} dt = \int_0^{\frac{\pi}{2}} 2 dt = \pi \quad (18.34)$$

B.5.3. Связь гамма-функции и бета-функции

Теорема. Для любых $a, b > 0$ справедливо

$$B(a, b) = \frac{\Gamma(a)\Gamma(b)}{\Gamma(a+b)} \quad (18.35)$$

Доказательство. \square

$$\Gamma(a) = \int_0^{\infty} 2x^{2a-1} e^{-x^2} dx \quad (18.36)$$

$$\Gamma(b) = \int_0^{\infty} 2y^{2b-1} e^{-y^2} dy \quad (18.37)$$

$$\Gamma(a) \cdot \Gamma(b) = \int_0^{\infty} y^{b-1} e^{-y} dy \int_0^{\infty} x^{a-1} e^{-x} dx \quad (18.38)$$

Произведение этих интегралов можно воспринимать как повторный, поэтому запишем теперь его как двойной по области $D = \{(x, y) \mid x, y \geq 0\}$.

$$\Gamma(a) \cdot \Gamma(b) = \iint_D 4x^{2a-1} y^{2b-1} e^{-x^2-y^2} dx dy \quad (18.39)$$

Перейдём в полярные координаты:

$$\begin{cases} x = r \cos \varphi \\ y = r \sin \varphi \\ dx dy = r dr d\varphi \end{cases} \quad (18.40)$$

$$\begin{aligned}\Gamma(a) \cdot \Gamma(b) &= \iint_D 4r^{2a+2b-1} (\cos \varphi)^{2a-1} (\sin \varphi)^{2b-1} e^{-r^2} dr d\varphi = \\ &= \int_0^{\frac{\pi}{2}} 2(\cos \varphi)^{2a-1} (\sin \varphi)^{2b-1} d\varphi \int_0^{\infty} 2r^{2(a+b)-1} e^{-r^2} dr\end{aligned}\tag{18.41}$$

Поскольку границы внутреннего интеграла не зависят от φ , то можно считать данную запись произведением двух отдельных интегралов! Но интеграл по φ , согласно ((18.32)), есть бета-функция, а интеграл по r — гамма-функция. Окончательно имеем:

$$\Gamma(a) \cdot \Gamma(b) = B(b, a) \cdot \Gamma(a + b) \Rightarrow B(b, a) = \frac{\Gamma(a) \cdot \Gamma(b)}{\Gamma(a + b)}\tag{18.42}$$

■

Следствие 1. Из этого соотношения так же видно, что $B(a, b) = B(b, a)$.

Следствие 2. Гамма-функция в $\frac{1}{2}$ и интеграл Эйлера-Пуассона.

$$\Gamma\left(\frac{1}{2}\right) = \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-x^2} dx = \sqrt{\pi}\tag{18.43}$$

Доказательство. □ Запишем, используя связь ((18.35)):

$$B\left(\frac{1}{2}, \frac{1}{2}\right) = \frac{\Gamma(\frac{1}{2})\Gamma(\frac{1}{2})}{\Gamma(\frac{1}{2} + \frac{1}{2})}\tag{18.44}$$

Учитывая, что $B\left(\frac{1}{2}, \frac{1}{2}\right) = \pi$ и $\Gamma(1) = 1$, получим:

$$\left[\Gamma\left(\frac{1}{2}\right)\right]^2 = \pi\tag{18.45}$$

Следовательно, $\Gamma\left(\frac{1}{2}\right) = \sqrt{\pi}$. Но с другой стороны,

$$\Gamma\left(\frac{1}{2}\right) = 2 \int_0^{\infty} e^{-x^2} dx = \int_{-\infty}^{\infty} e^{-x^2} dx\tag{18.46}$$

■

B.6. Числовые ряды

Определение. Выражение $a_1 + a_2 + \dots + a_n + \dots$ называют **рядом с общим членом** a_n и обозначают

$$\sum_{n=1}^{\infty} a_n \quad (19.1)$$

Определение. Элементы последовательности $\{a_n\}$ называются членами ряда.

Определение. n -ой частичной суммой ряда с общим членом $\{a_i\}$ называется сумма

$$s_n = \sum_{i=1}^n a_i \quad (19.2)$$

Определение. Если последовательность частичных сумм $\{s_n\}$ для ряда с общим членом $\{a_n\}$ имеет предел, то ряд называется **сходящимся**. Если последовательность частичных сумм предела не имеет, то ряд называется **расходящимся**.

Определение. Суммой ряда называется предел последовательности его частичных сумм.

$$s = \lim_{n \rightarrow \infty} s_n \quad (19.3)$$

Если ряд сходится, то найдя его сумму, пишут

$$\sum_{n=1}^{\infty} a_n = s \quad (19.4)$$

Остатком ряда называется разность между n -й частичной суммой и суммой ряда.

$$r_n = s - s_n \quad (19.5)$$

Свойства рядов:

1. Отбрасывание конечного количества членов ряда не влияет на его сходимость.
2. Для сходящегося ряда остаток стремится к нулю при $n \rightarrow \infty$.
3. Если все члены сходящегося ряда умножить на константу $c \in \mathbb{R} \setminus \{0\}$, то ряд из умноженных членов так же сходится, а его сумма равна $c \cdot s$.
4. Если ряды $A = (a_1 + a_2 + \dots)$ и $B = (b_1 + b_2 + \dots)$ сходятся, то ряд, для которого $c_n = a_n + b_n$

$$C = c_1 + c_2 + \dots \quad (19.6)$$

тоже сходится, причём $C = A + B$.

B.6.1. Необходимый признак сходимости ряда

Теорема(необходимый признак сходимости ряда). Если ряд сходится, то его общий член стремится к нулю при неограниченном возрастании n .

$$\sum_{n=1}^{\infty} a_n \text{ сходится} \Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} a_n = 0 \quad (19.7)$$

Доказательство. \square Пусть для сходящегося ряда

$$\sum_{n=1}^{\infty} a_n \quad (19.8)$$

определенна последовательность частичных сумм $\{s_n\}$. Пусть

$$s = \lim_{n \rightarrow \infty} s_n \quad (19.9)$$

Заметим, что $a_n = s_n - s_{n-1}$. Тогда

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = \lim_{n \rightarrow \infty} (s_n - s_{n-1}) = s - s = 0 \quad (19.10)$$

Что и требовалось доказать. ■

B.6.2. Признаки сходимости положительных рядов

Пусть, начиная с некоторого номера N , $\forall n \geq N : a_n \geq 0$. Тогда ряд $\sum_{n=1}^{\infty} a_n$ назовём *положительным*.

Основная теорема сходимости. Положительный ряд всегда имеет сумму. Если последовательность частичных сумм ограничена сверху, то ряд сходится, иначе расходится.

Доказательство. \square Поскольку $a_n \geq 0$ начиная с некоторого номера N , то $\forall n \geq N : s_{n+1} = s_n + a_{n+1} \geq s_n$. Следовательно последовательность $\{s_n\}$ монотонно не убывает. Так как по условию теоремы $\{s_n\}$ ограничена сверху, то у неё есть предел \Rightarrow ряд из членов $\{a_n\}$ сходится. Если же последовательность $\{s_n\}$ не ограничена сверху, то у неё нет предела и ряд расходится. ■

B.6.2.1. Теоремы сравнения

Теорема 1. Пусть даны два положительных ряда

$$\sum_{n=1}^{\infty} a_n \quad (19.11)$$

и

$$\sum_{n=1}^{\infty} b_n \quad (19.12)$$

Если $\forall n \geq N : a_n \leq b_n$, то

- Из сходимости ряда $\{b_n\}$ следует сходимость ряда $\{a_n\}$.
- Из расходимости ряда $\{a_n\}$ следует расходимость ряда $\{b_n\}$.

Доказательство. \square Не умаляя общности рассуждений считаем $0 \leq a_n \leq b_n \forall n \in \mathbb{N}$, так как конечное число слагаемых ряда можно отбросить. Пусть A_n, B_n - частичные суммы рядов $\{a_n\}$ и $\{b_n\}$. Если ряд $\{b_n\}$ сходится, то по основной теореме о сходимости существует такая константа L , что

$$B_n \leq L \quad (19.13)$$

учитывая, что $A_n \leq B_n$, получаем $A_n \leq L$. Это и означает что ряд $\{a_n\}$ сходится. ■

Теорема 2. Если существует предел $\lim_{n \rightarrow \infty} \left(\frac{a_n}{b_n} \right) = K$ и при этом ($0 \leq K \leq +\infty$), то

1. Если $K < +\infty$, то из сходимости $\{b_n\}$ следует сходимость $\{a_n\}$
2. Если $K > 0$, то из расходимости $\{b_n\}$ следует расходимость $\{a_n\}$
3. Если $0 < K < +\infty$, то ряды $\{a_n\}$ и $\{b_n\}$ сходятся и расходятся одновременно.

Доказательство. \square

1. Пусть $\sum b_n$ сходится и $K < +\infty$. Тогда по определению предела последовательности, для всех достаточно больших $n \exists \varepsilon > 0$, такой, что

$$\frac{a_n}{b_n} - K < \varepsilon \quad (19.14)$$

Следовательно, $a_n < (K + \varepsilon)b_n$. По первой теореме сравнения, из сходимости b_n следует сходимость a_n .

2. Пусть $\sum b_n$ расходится и $K > 0$. Тогда $\lim \frac{b_n}{a_n}$ обязательно конечен. Предположим, что ряд $\sum a_n$ сходится, тогда по только что доказанному п. 1 ряд $\sum b_n$ должен сходиться. Получили противоречие, и значит при расходимости $\sum b_n$ ряд $\sum a_n$ расходится.

Пересекая оба случая, получаем истинность пункта 3. ■

Теорема 3. Если для положительных рядов, начиная с некоторого номера, верно, что

$$\frac{a_{n+1}}{a_n} \leq \frac{b_{n+1}}{b_n} \quad (19.15)$$

,

то их сходимости $\sum b_n$ следует сходимость $\sum a_n$, а из расходимости $\sum a_n$ следует расходимость b_n .

Доказательство. \square Не умаляя общности можно сказать, что неравенство из условия теоремы верно для всех $n \in \mathbb{N}$. Тогда

$$\frac{a_2}{a_1} \leq \frac{b_2}{b_1}; \frac{a_3}{a_2} \leq \frac{b_3}{b_2}; \dots \frac{a_n}{a_{n-1}} \leq \frac{b_n}{b_{n-1}}. \quad (19.16)$$

Перемножим все эти неравенства и получим

$$\frac{a_n}{a_1} \leq \frac{b_n}{b_1} \Leftrightarrow a_n \leq \left(\frac{a_1}{b_1} \right) b_n \quad (19.17)$$

Это означает по первой теореме, что из сходимости b_n следует сходимость a_n , а из расходимости a_n следует расходимость b_n . ■

B.6.2.2. Радикальный признак Коши

Радикальный признак Коши. Пусть $0 < q < 1$. Составим для ряда $\sum a_n$ выражение

$$b_n = \sqrt[n]{a_n} \quad (19.18)$$

Если для достаточно больших n выполняется $b_n < q$, где постоянная $q < 1$, то ряд $\sum a_n$ сходится. Если же $b_n \geq 1$, то ряд расходится.

Доказательство. \square геометрическая прогрессия $\sum q^n$ сходится при $q < 1$. Сравним ряд $\sum a_n$ с геометрической прогрессией. Если $\sqrt[n]{a_n} < q$ для достаточно больших n , то

$$a_n < q^n \quad (19.19)$$

По первой теореме сравнения, ряд $\sum a_n$ сходится. Если же, начиная с некоторого номера, $a_n \geq 1$, то либо из сравнения с расходящимся рядом $(1 + 1 + 1 + \dots)$, либо из нарушения необходимого признака сходимости, получаем, что ряд $\sum a_n$ расходится.

Радикальный признак Коши в предельной форме. Пусть для положительного ряда $\sum a_n$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n]{a_n} = l \quad (19.20)$$

1. Если $l < 1$, то ряд $\sum a_n$ сходится.
2. Если $l > 1$, то ряд $\sum a_n$ расходится.
3. Если $l = 1$, то ряд может как сходиться, так и расходиться.

Доказательство. □

- Пусть $l < 1$. Возьмём такое $\varepsilon > 0$, что $l + \varepsilon < 1$. Тогда по определению предела, для достаточно больших n будет верно, что

$$\sqrt[n]{a_n} < l + \varepsilon < 1 \quad (19.21)$$

По радикальному признаку Коши ряд $\sum a_n$ сходится.

- Пусть теперь $l > 1$. Тогда существует такое q , что $1 < q < l$. По определению предела, для достаточно больших n будет верно, что

$$\sqrt[n]{a_n} \geq q \geq 1 \quad (19.22)$$

По радикальному признаку Коши ряд $\sum a_n$ расходится. ■

B.6.2.3. Признак Даламбера

Признак Даламбера. Для положительного ряда $\sum a_n$ определим величину

$$D_n = \frac{a_{n+1}}{a_n} \quad (19.23)$$

Если для достаточно больших n выполнено $D_n \leq q < 1$, где q - постоянное число, то ряд сходится. Если же $D_n \geq 1$, то ряд расходится.

Доказательство. □

- Пусть $D_n \leq q < 1$ для достаточно больших n . Рассмотрим геометрическую прогрессию $\sum q^n$. Она сходится при $q < 1$. Сравним ряд $\sum a_n$ с ней, имея в виду, что $\frac{q^{n+1}}{q^n} = q$.

$$\frac{a_{n+1}}{a_n} \leq q = \frac{q^{n+1}}{q^n} \quad (19.24)$$

По третьей теореме сравнения, из сходимости ряда $\sum q^n$ следует сходимость ряда $\sum a_n$.

- Пусть теперь $D_n \geq 1$ для достаточно больших n . Тогда либо из сравнения с расходящимся рядом $(1 + 1 + 1 + \dots)$, либо из нарушения необходимого признака сходимости, получаем, что ряд $\sum a_n$ расходится. ■

Признак Даламбера в предельной форме. Пусть для положительного ряда $\sum a_n$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \left(\frac{a_{n+1}}{a_n} \right) = D \quad (19.25)$$

1. Если $D < 1$, то ряд $\sum a_n$ сходится.
2. Если $D > 1$, то ряд $\sum a_n$ расходится.
3. Если $D = 1$, то ряд может как сходиться, так и расходиться.

Доказательство. \square

1. Пусть $D < 1$. Возьмём такое $\varepsilon > 0$, что $D + \varepsilon < 1$. Тогда по определению предела, для достаточно больших n будет верно, что

$$\frac{a_{n+1}}{a_n} < D + \varepsilon < 1 \quad (19.26)$$

По признаку Даламбера ряд $\sum a_n$ сходится.

2. Пусть теперь $D > 1$. Тогда существует такое q , что $1 < q < D$. По определению предела, для достаточно больших n будет верно, что

$$\frac{a_{n+1}}{a_n} \geq q \geq 1 \quad (19.27)$$

По признаку Даламбера ряд $\sum a_n$ расходится. ■

B.6.2.4. Признак Раабе

Признак Раабе. Для положительного ряда $\sum a_n$ определим величину

$$R_n = n \left(1 - \frac{a_{n+1}}{a_n} \right) \quad (19.28)$$

Если для достаточно больших n выполнено $R_n \geq r > 1$, где r - постоянное число, то ряд сходится. Если же $R_n \leq 1$, то ряд расходится.

Доказательство. \square

1. Пусть $R_n \geq r > 1$ для достаточно больших n . Это эквивалентно тому, что

$$\frac{a_{n+1}}{a_n} \leq 1 - \frac{r}{n} \quad (19.29)$$

Используем лемму:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{\left(1 - \frac{1}{n}\right)^s - 1}{-\frac{1}{n}} = s \quad (19.30)$$

Мозьмём такое число s , что $1 < s < r$. Тогда для достаточно больших n будет верно, что

$$\frac{\left(1 - \frac{1}{n}\right)^s - 1}{-\frac{1}{n}} < r \Leftrightarrow 1 - \frac{r}{n} < \left(1 - \frac{1}{n}\right)^s \quad (19.31)$$

Полученное неравенство эквивалентно такому:

$$\frac{a_{n+1}}{a_n} < \left(\frac{n-1}{n}\right)^s = \frac{\frac{1}{n^s}}{\frac{1}{(n-1)^s}} \quad (19.32)$$

Справа стоит отношение следующего члена *сходящегося* обобщённого гармонического ряда H_s ($s > 1$), поэтому по третьей теореме сравнения из сходимости ряда H_s следует сходимость ряда $\sum a_n$.

2. Пусть теперь $R_n \leq 1$ для достаточно больших n . Имеем:

$$n\left(1 - \frac{a_{n+1}}{a_n}\right) \leq 1 \Leftrightarrow \frac{a_{n+1}}{a_n} \geq \frac{1}{1 + \frac{1}{n}} = \frac{n}{n+1} = \frac{\frac{1}{n+1}}{\frac{1}{n}} \quad (19.33)$$

Справа стоит отношение следующего члена *расходящегося* гармонического ряда H_1 . Поэтому по третьей теореме сравнения из расходимости ряда H_1 следует расходимость ряда $\sum a_n$. ■

Признак Раабе в предельной форме. Пусть для положительного ряда $\sum a_n$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} n\left(1 - \frac{a_{n+1}}{a_n}\right) = R \quad (19.34)$$

1. Если $R > 1$, то ряд $\sum a_n$ сходится.
2. Если $R < 1$, то ряд $\sum a_n$ расходится.
3. Если $R = 1$, то ряд может как сходиться, так и расходиться.

Признак Раабе существенно сильнее признака Даламбера.

B.6.2.5. Интегральный признак Маклорена-Коши

Интегральный признак Маклорена-Коши. Пусть ряд можно представить в виде

$$\sum_{n=1}^{\infty} a_n \equiv \sum_{n=1}^{\infty} f(n) \quad (19.35)$$

где $f(n)$ – значение при $x = n$ непрерывной положительной монотонно убывающей функции $f(x)$ на полуинтервале $[1, +\infty)$.

Тогда ряд $\sum a_n$ сходится тогда и только тогда, когда сходится интеграл

$$\int_1^\infty f(x)dx \text{ сходится} \Leftrightarrow \sum_{n=1}^\infty a_n \text{ сходится} \quad (19.36)$$

Доказательство. \square Рассмотрим произвольную первообразную функцию $F(x)$ для $f(x)$ на полуинтервале $[1, +\infty)$:

$$F(x) = \int_1^x f(t)dt \quad (19.37)$$

Ясно, что $0 < f(x) = F'(x)$, поэтому $F(x) \nearrow$. Поскольку $f(x)$ монотонно убывает, то для $x : n \leq x \leq n+1$:

$$a_{n+1} = f(n+1) \leq f(x) \leq f(n) = a_n \quad (19.38)$$

$$a_{n+1} \leq \int_n^{n+1} f(t)dt \leq a_n \quad (19.39)$$

Мы получили оценку для общего члена такого ряда:

$$\sum_{n=1}^\infty \int_n^{n+1} f(t)dt \quad (19.40)$$

Его n -я частичная сумма равна

$$s_n = \int_1^{n+1} f(t)dt = F(n+1) - F(1) \underset{\text{сход.}}{\sim} F(n+1) \quad (19.41)$$

Итак, проанализируем предел

$$L = \lim_{x \rightarrow \infty} F(x) \quad (19.42)$$

- Если $L < \infty$, то ряд $\sum a_{n+1}$ сходится по первой теореме сравнения как меньший либо равный сходящемуся ряду. И из сходимости $\sum a_{n+1}$ следует сходимость $\sum a_n$.
- Если $L = \infty$, то ряд $\sum a_n$ расходится по первой теореме сравнения как больший либо равный расходящемуся ряду.

Таким образом, ряд $\sum a_n$ сходится тогда и только тогда, когда сходится интеграл $\int_1^\infty f(x)dx$. ■

B.6.3. Сходимость произвольных рядов

Пусть задан ряд $\sum a_n$, где члены a_n имеют произвольные знаки. Вопрос его сходимости сводится к сходимости последовательности частичных сумм $\{s_n\}_{n=1}^{\infty}$:

$$s_1, s_2, \dots, s_n, s_{n+1}, \dots, s_{n+m}, \dots \quad (19.43)$$

Ряд $\sum a_n$ сходится тогда и только тогда, когда последовательность $\{s_n\}$ фундаментальна, то есть

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N : \forall n > N, \forall m \in \mathbb{N} : |s_{n+m} - s_n| < \varepsilon \quad (19.44)$$

B.6.3.1. Абсолютная сходимость

Абсолютная сходимость. Ряд $\sum a_n$ называется абсолютно сходящимся, если сходится ряд $\sum |a_n|$.

Теорема Коши. Если ряд $\sum a_n$ сходится абсолютно, то он сходится.

Доказательство. \square Из абсолютной сходимости мы знаем, что начиная с некоторого номера и для всех $m \in \mathbb{N}$:

$$\forall \varepsilon > 0 : \left| \sum_{i=0}^m |a_{n+i}| \right| < \varepsilon \quad (19.45)$$

Поскольку подмодульное выражение неотрицательно, то отбрасываем модуль:

$$\sum_{i=0}^m |a_{n+i}| < \varepsilon \quad (19.46)$$

Но с другой стороны, используем неравенство треугольника:

$$\left| \sum_{i=0}^m a_{n+i} \right| \leq \sum_{i=0}^m |a_{n+i}| < \varepsilon \quad (19.47)$$

Значит, ряд $\sum a_n$ сходится. ■

Кроме того, если ряд $\sum a_n$ сходится абсолютно, то ряды

$$\sum_{k=1}^{\infty} b_k \quad \text{и} \quad \sum_{m=1}^{\infty} c_m, \quad (19.48)$$

где b_k - положительные члены ряда $\sum a_n$ в порядке следования, а c_m - модули отрицательных членов ряда $\sum a_n$ в порядке следования, сходятся. И имеет место

$$\sum_{n=1}^{\infty} a_n = \sum_{k=1}^{\infty} b_k - \sum_{m=1}^{\infty} c_m \quad (19.49)$$

B.6.3.2. Знакопеременные ряды и признак Лейбница

Ряд $\sum a_n$ называется знакопеременным, если $\forall n \in \mathbb{N} : a_n \cdot a_{n+1} < 0$.

Не умаляя общности, можно давать такое определение для всех $n \in \mathbb{N}$, так как конечное число членов ряда можно отбросить и перенумеровать оставшиеся с сохранением сходимости.

То же самое можно написать и так:

$$\sum_{n=1}^{\infty} a_n = \sum_{n=1}^{\infty} (-1)^n c_n, \quad (19.50)$$

где $c_n > 0$.

Признак Лейбница. Пусть ряд $\sum a_n$ является знакопеременным. Если все члены ряда убывают по абсолютной величине и стремятся к нулю, то ряд $\sum a_n$ сходится.

Доказательство. \square Пусть $c_n = |a_n|$, и S_{2m} - частичная сумма чётного порядка:

$$S_{2m} = c_1 - c_2 + c_3 - \dots + c_{2m-1} - c_{2m} \quad (19.51)$$

$$S_{2m} = (c_1 - c_2) + (c_3 - c_4) + \dots + (c_{2m-1} - c_{2m}) \quad (19.52)$$

Поскольку $c_i > c_{i+1}$, то S_{2m} с ростом m возрастает.

$$S_{2m} = c_1 - (c_2 - c_3) - \dots - (c_{2m-2} - c_{2m-1}) - c_{2m} \quad (19.53)$$

Выходит, что S_{2m} ограничена сверху c_1 . Тогда последовательность S_{2m} сходится как возрастающая и ограниченная сверху.

$$\lim_{m \rightarrow \infty} S_{2m} = S \quad (19.54)$$

Для суммы нечётного порядка имеем $S_{2m-1} = S_{2m} + c_{2m}$.

Поэтому, используя, что $c_{2m} \rightarrow 0$:

$$\lim_{m \rightarrow \infty} S_{2m-1} = S \quad (19.55)$$

Последовательности как чётных, так и нечётных сумм данного ряда сходятся к одному числу, следовательно, ряд сходится. ■

B.7. Начало комплексного анализа

B.7.1. Предел комплексной последовательности

Определение. Пусть ε -окрестностью точки $a \in \mathbb{C}$ называется множество

$$B_\varepsilon(a) := \{z \in \mathbb{C} : |z - a| < \varepsilon\}, \quad (20.1)$$

а проколотой ε -окрестностью точки $a \in \mathbb{C}$ называется множество

$$\mathring{B}_\varepsilon(a) := \{z \in \mathbb{C} : 0 < |z - a| < \varepsilon\} \quad (20.2)$$

Определение. Говорят, что последовательность комплексных чисел $\{z_n\}_{n=1}^\infty$ сходится к комплексному числу $A \in \mathbb{C}$, если

$$\forall \varepsilon > 0, \exists N_\varepsilon \in \mathbb{N}, \forall n \geq N_\varepsilon : z_n \in B_\varepsilon(A). \quad (20.3)$$

Это эквивалентно такому условию:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} |z_n - A| = 0. \quad (20.4)$$

Обозначение:

$$\boxed{\lim_{n \rightarrow \infty} z_n = A}$$

Пусть теперь $z_n = x_n + iy_n$, где $x_n, y_n \in \mathbb{R}$. Тогда последовательность $\{z_n\}_{n=1}^\infty$ сходится к $A = a + ib$, если и только если последовательности $\{x_n\}_{n=1}^\infty$ и $\{y_n\}_{n=1}^\infty$ сходятся к a и b соответственно.

Доказательство. \square $|z_n - A| = |(x_n + iy_n) - (a + ib)| = \sqrt{(x_n - a)^2 + (y_n - b)^2} \geq |x_n - a|$ и аналогично для y_n . Тогда

$$z_n \rightarrow A \Rightarrow \begin{cases} x_n \rightarrow a, \\ y_n \rightarrow b. \end{cases} \quad (20.5)$$

Обратно, пусть $x_n \rightarrow a$ и $y_n \rightarrow b$. Тогда для любого $\varepsilon > 0$ найдутся такие $N_1, N_2 \in \mathbb{N}$, что при $n \geq N_1$ будет выполняться неравенство $|x_n - a| < \frac{\varepsilon}{2}$, а при $n \geq N_2$ будет выполняться неравенство $|y_n - b| < \frac{\varepsilon}{2}$. Пусть $N = \max(N_1, N_2)$. Тогда при $n \geq N$ будет выполняться неравенство

$$|z_n - A| = \sqrt{(x_n - a)^2 + (y_n - b)^2} \leq |x_n - a| + |y_n - b| < \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon}{2} = \varepsilon. \quad (20.6)$$

■

Определение. Говорят, что $z_n \rightarrow \infty$, если $\forall \varepsilon > 0 \ \exists N_\varepsilon \in \mathbb{N} : \forall n \geq N_\varepsilon : |z_n| > \varepsilon$.

Обозначим $\mathring{B}_\varepsilon(\infty) := \{z \in \mathbb{C} : |z| > \varepsilon\}$. Тогда ясно, что можно написать, заменив в определении предела \mathbb{C} на $\bar{\mathbb{C}} := \mathbb{C} \cup \{\infty\}$:

$$z_n \rightarrow \infty \Leftrightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} z_n = \infty. \quad (20.7)$$

B.7.2. Сфера Римана

Пусть у нас есть \mathbb{R}^3 и сфера с центром $(0, 0, \frac{1}{2})$ и радиусом $\frac{1}{2}$. Она называется сферой Римана. Для любой точки комплексной плоскости \mathbb{C} можно соединить её прямой с точкой $(0, 0, 1)$, и эта прямая пересекает сферу Римана в некоторой точке. Таким образом, каждой точке $z \in \mathbb{C}$ сопоставляется точка на сфере Римана. Точку $(0, 0, 1)$ сферы Римана будем называть точкой на бесконечности и обозначать ∞ . Тогда каждой точке $z \in \bar{\mathbb{C}}$ сопоставляется точка на сфере Римана и обратно.

B.7.3. Ряды комплексных чисел

Определение. Пусть $\{z_n\}_{n=1}^\infty$ — последовательность комплексных чисел. Тогда ряд комплексных чисел — это выражение вида $\sum_{n=1}^\infty z_n$. Ряд называется сходящимся, если сходится последовательность частичных сумм $S_k = \sum_{n=1}^k z_n$. В этом случае его сумма определяется как предел этой последовательности:

$$\sum_{n=1}^\infty z_n = \lim_{k \rightarrow \infty} S_k \quad (20.8)$$

Предложение. Ряд $\sum_{n=1}^\infty z_n$ сходится тогда и только тогда, когда сходятся ряды $\sum_{n=1}^\infty \operatorname{Re}(z_n)$ и $\sum_{n=1}^\infty \operatorname{Im}(z_n)$.

В случае сходимости ряда $\sum_{n=1}^\infty z_n$ его сумма равна

$$\sum_{n=1}^\infty z_n = \sum_{n=1}^\infty \operatorname{Re}(z_n) + i \sum_{n=1}^\infty \operatorname{Im}(z_n). \quad (20.9)$$

Предложение (Критерий Коши). Ряд $\sum_{n=1}^\infty z_n$ сходится тогда и только тогда, когда

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N_\varepsilon \in \mathbb{N}, \forall n \geq N_\varepsilon \forall p \in \mathbb{N} : \left| \sum_{k=n+1}^{n+p} z_k \right| < \varepsilon. \quad (20.10)$$

B.8. Комплексные функции

B.8.1. Предел и непрерывность функции комплексного переменного

Определение. Пусть $D \subset \bar{\mathbb{C}}$. Функцией комплексного переменного называется отображение $f : G \rightarrow \bar{\mathbb{C}}$.

Определение. Пусть $f : G \rightarrow \bar{\mathbb{C}}$ - функция комплексного переменного, $z_0 \in \bar{\mathbb{C}}$ – предельная точка множества $G \subset \bar{\mathbb{C}}$. Тогда $A \in \bar{\mathbb{C}}$ называется пределом функции f при в точке z_0 , если

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 : \forall z \in \overset{\circ}{B}_\delta(z_0) \cap G : f(z) \in B_\varepsilon(A). \quad (21.1)$$

Обозначение: $\lim_{\substack{G \\ z \rightarrow z_0}} f(z) = A$.

Если z_0 – внутренняя точка множества G , то предел функции f при $z \rightarrow z_0$ не зависит от G и просто пишут $\lim_{z \rightarrow z_0} f(z) = A$.

Пусть $u(x, y) = \operatorname{Re} f$, $v(x, y) = \operatorname{Im} f$.

Предложение. Если $\mathbb{C} \ni z_0 = x_0 + iy_0$, $A \in \mathbb{C}$, то $\lim_{z \rightarrow z_0} f(z) = A$ тогда и только тогда, когда

$$\begin{cases} \lim_{(x,y) \rightarrow (x_0,y_0)} u(x, y) = \operatorname{Re} A, \\ \lim_{(x,y) \rightarrow (x_0,y_0)} v(x, y) = \operatorname{Im} A. \end{cases} \quad (21.2)$$

Определение. Функция $f : G \rightarrow \bar{\mathbb{C}}$ называется непрерывной в точке $z_0 \in G$, если $\lim_{z \rightarrow z_0} f(z) = f(z_0)$.

Предложение. Функция $f : G \rightarrow \bar{\mathbb{C}}$ непрерывна в точке $z_0 \in G$, тогда и только тогда, когда функции $u(x, y) = \operatorname{Re} f$ и $v(x, y) = \operatorname{Im} f$ непрерывны в точке (x_0, y_0) , где $z_0 = x_0 + iy_0$.

Определение. Функция f называется непрерывной на множестве G , если она непрерывна в каждой точке множества G .

Примеры непрерывных функций:

1. Многочлены: $P(z) = a_n z^n + a_{n-1} z^{n-1} + \dots + a_1 z + a_0$.
2. Рациональные функции: $R(z) = \frac{P(z)}{Q(z)}$, где $P(z)$ и $Q(z)$ – многочлены, $Q(z) \neq 0$.
3. $f(z) = \bar{z}$.

Отсюда можно получить теоремы о непрерывности и пределах, связанные с арифметическими операциями и композицией функций.

B.8.2. Производная функции комплексного переменного

Определение. Пусть f определена в некоторой окрестности точки $z_0 \in \mathbb{C}$ и существует конечный предел $\lim_{z \rightarrow z_0} \frac{f(z) - f(z_0)}{z - z_0}$ называется производной функции f в точке z_0 .

Обозначаем производную в точке z_0 как $f'(z_0)$, а также $\Delta z = z - z_0$, $\Delta f = f(z) - f(z_0)$,

$$\frac{\Delta f}{\Delta z} = f'(z_0) + \varepsilon(\Delta z), \quad (21.3)$$

где $\varepsilon(\Delta z) \rightarrow 0$ при $\Delta z \rightarrow 0$.

Отсюда $\Delta f = f'(z_0)\Delta z + \varepsilon(\Delta z)\Delta z$. Обозначим $\alpha(\Delta z) = \varepsilon(\Delta z)\Delta z$.

Тогда $\lim_{\Delta z \rightarrow 0} \frac{\alpha(\Delta z)}{\Delta z} = 0$. В этом случае говорят, что

$$\alpha(\Delta z) = o(\Delta z) \text{ при } \Delta z \rightarrow 0. \quad (21.4)$$

Определение. Функция f , определённая в некоторой окрестности точки $z_0 \in \mathbb{C}$, называется дифференцируемой в точке z_0 , если её приращение можно представить в виде

$$\Delta f = A \cdot \Delta z + o(\Delta z) \text{ при } \Delta z \rightarrow 0, \quad (21.5)$$

где $A \in \mathbb{C}$. Тогда можно показать, что $A = f'(z_0)$.

Теоремы о дифференцируемости, связанные с арифметическими операциями и композицией функций, аналогичны теоремам для функций действительного переменного.

B.8.3. Условия дифференцируемости

Оказывается, что дифференцируемость функции комплексного переменного требует более строгих условий, чем дифференцируемость соответствующих функций $u(x, y)$ и $v(x, y)$.

Например, $f(z) = \operatorname{Re} z$ не является дифференцируемой ни в одной точке, хотя соответствующие функции $u(x, y) = x$ и $v(x, y) = 0$ дифференцируемы всюду.

■ **Теорема.** Пусть $f(z) = u(x, y) + iv(x, y)$ определена в некоторой окрестности точки $z_0 = x_0 + iy_0$. Тогда для того, чтобы f была дифференцируема в точке z_0 , необходимо и достаточно, чтобы

1. Функции u, v были дифференцируемы в точке (x_0, y_0) .
2. Условия Коши-Римана выполнялись в точке (x_0, y_0) :

$$\begin{cases} \frac{\partial u}{\partial x}(x_0, y_0) = \frac{\partial v}{\partial y}(x_0, y_0), \\ \frac{\partial u}{\partial y}(x_0, y_0) = -\frac{\partial v}{\partial x}(x_0, y_0). \end{cases} \quad (21.6)$$

тогда

$$f'(z_0) = \frac{\partial u}{\partial x}(x_0, y_0) + i \frac{\partial v}{\partial x}(x_0, y_0). \quad (21.7)$$

Доказательство. □

1. Необходимость. Пусть f дифференцируема в точке z_0 и $f'(z_0) = a + ib$. Тогда $\Delta f = f'(z_0)\Delta z + o(\Delta z) = (a + ib)(\Delta x + i\Delta y) + \alpha_1(\Delta x, \Delta y) + i\alpha_2(\Delta x, \Delta y)$. Тогда, имея в виду $\Delta f = \Delta u + i\Delta v$, получаем:

$$\begin{cases} \Delta u = a\Delta x - b\Delta y + \alpha_1(\Delta x, \Delta y) \\ \Delta v = b\Delta x + a\Delta y + \alpha_2(\Delta x, \Delta y) \end{cases} \quad (21.8)$$

Мы знаем, что $\alpha(z) = o(\Delta z)$, то есть $\lim_{\Delta z \rightarrow 0} \frac{|\alpha(\Delta z)|}{\Delta z} = 0$. Кроме того, $|\alpha_1| \leq |\alpha|$ и $|\alpha_2| \leq |\alpha|$. Следовательно, $\lim_{\Delta z \rightarrow 0} \frac{|\alpha_1(\Delta x, \Delta y)|}{\sqrt{\Delta x^2 + \Delta y^2}} = 0$ и $\lim_{\Delta z \rightarrow 0} \frac{|\alpha_2(\Delta x, \Delta y)|}{\sqrt{\Delta x^2 + \Delta y^2}} = 0$. Отсюда следует, что функции u и v дифференцируемы в точке (x_0, y_0) и

$$\begin{aligned} a &= \frac{\partial u}{\partial x}(x_0, y_0) = \frac{\partial v}{\partial y}(x_0, y_0), \\ -b &= \frac{\partial u}{\partial y}(x_0, y_0) = -\frac{\partial v}{\partial x}(x_0, y_0). \end{aligned} \quad (21.9)$$

2. Достаточность. Пусть функции u и v дифференцируемы в точке (x_0, y_0) и условия Коши-Римана выполняются в этой точке.

$$\begin{aligned} \Delta f &= \Delta u + i\Delta v = \frac{\partial u}{\partial x}\Delta x + \frac{\partial u}{\partial y}\Delta y + \alpha_1(\Delta x, \Delta y) + i\left(\frac{\partial v}{\partial x}\Delta x + \frac{\partial v}{\partial y}\Delta y + \alpha_2(\Delta x, \Delta y)\right) = \\ &= \left(\frac{\partial u}{\partial x} + i\frac{\partial v}{\partial x}\right)(\Delta x + i\Delta y) + \alpha_1(\Delta x, \Delta y) + i\alpha_2(\Delta x, \Delta y) \end{aligned} \quad (21.10)$$

Но, обозначив $\alpha(\Delta x, \Delta y) = \alpha_1(\Delta x, \Delta y) + i\alpha_2(\Delta x, \Delta y)$, получаем

$$\left| \frac{\alpha(\Delta x, \Delta y)}{\Delta z} \right| \leq \frac{|\alpha_1(\Delta x, \Delta y)| + |\alpha_2(\Delta x, \Delta y)|}{\sqrt{\Delta x^2 + \Delta y^2}} \xrightarrow[z \rightarrow z_0]{} 0. \quad (21.11)$$

Итак, $\Delta f = A \cdot \Delta z + o(\Delta z)$, где $A = \frac{\partial u}{\partial x} + i \frac{\partial v}{\partial x}$, таким образом, f дифференцируема в точке z_0 и $f'(z_0) = A$. ■

Определение. Функция f называется регулярной (или голоморфной) в области $G \subset \mathbb{C}$, если она дифференцируема в каждой точке этой области.

Определение. Функцию называют регулярной в точке z_0 , если она регулярна в некоторой окрестности этой точки.

Например, функция $f(z) = |z|^2$ не является регулярной ни в одной точке, включая $z = 0$.

B.8.4. Комплексная экспонента

Определение. Комплексной экспонентой называют такую функцию от $z = x + iy$:

$$e^z := e^x(\cos y + i \sin y) \quad (21.12)$$

Ещё можно определить комплексную экспоненту с помощью ряда Тейлора:

$$e^z := \sum_{n=0}^{\infty} \frac{z^n}{n!}. \quad (21.13)$$

Найдем производную комплексной экспоненты, полагая $u(x, y) = e^x \cos y$, $v(x, y) = e^x \sin y$. Для этого проверим условия Коши-Римана:

$$\begin{cases} \frac{\partial u}{\partial x} = e^x \cos y = \frac{\partial v}{\partial y} \\ \frac{\partial u}{\partial y} = -e^x \sin y = -\frac{\partial v}{\partial x}. \end{cases} \quad (21.14)$$

это верно $\forall z \in \mathbb{C}$, поэтому e^z регулярна во всей комплексной плоскости и

$$(e^z)' = \frac{\partial u}{\partial x} + i \frac{\partial v}{\partial x} = e^x \cos y + ie^x \sin y = e^z. \quad (21.15)$$

Это же можно получить, продифференцировав ряд Тейлора почленно:

$$(e^z)' = \sum_{n=1}^{\infty} \frac{n z^{n-1}}{n!} = \sum_{n=1}^{\infty} \frac{z^{n-1}}{(n-1)!} = \sum_{m=0}^{\infty} \frac{z^m}{m!} = e^z. \quad (21.16)$$

B.8.5. Тригонометрические и гиперболические функции комплексного переменного

Определение. Комплексные синус и косинус определяются следующим образом

$$\begin{aligned}\sin z &:= \frac{e^{iz} - e^{-iz}}{2i}, \\ \cos z &:= \frac{e^{iz} + e^{-iz}}{2}.\end{aligned}\tag{21.17}$$

Можно показать, что если $z = x \in \mathbb{R}$, то эти определения совпадают с обычными определениями синуса и косинуса.

Функции $\sin z$ и $\cos z$ регулярны во всей комплексной плоскости, и их производные равны

$$\begin{aligned}(\sin z)' &= \cos z, \\ (\cos z)' &= -\sin z.\end{aligned}\tag{21.18}$$

Определение. Комплексные гиперболические функции определяются следующим образом:

$$\begin{aligned}\operatorname{sh} z &:= \frac{e^z - e^{-z}}{2}, \\ \operatorname{ch} z &:= \frac{e^z + e^{-z}}{2}.\end{aligned}\tag{21.19}$$

Функции $\operatorname{sh} z$ и $\operatorname{ch} z$ регулярны во всей комплексной плоскости, и их производные равны

$$\begin{aligned}(\operatorname{sh} z)' &= \operatorname{ch} z, \\ (\operatorname{ch} z)' &= \operatorname{sh} z.\end{aligned}\tag{21.20}$$

Связь между тригонометрическими и гиперболическими функциями выражается следующими формулами:

$$\begin{aligned}\operatorname{sh} z &= i \sin(iz), \\ \operatorname{ch} z &= \cos(iz).\end{aligned}\tag{21.21}$$

B.9. Комплексный интеграл

Пусть $\gamma = \{z(t) = x(t) + iy(t), t \in [t_1 t_2]\}$ – кусочно-гладкая кривая в комплексной плоскости и задана функция f , непрерывная на кривой γ . Тогда при этих условиях интегралом от функции f по кривой γ называют следующий интеграл:

$$\int_{\gamma} f(z) dz := \int_{t_1}^{t_2} f(z(t)) z'(t) dt. \quad (22.1)$$

Можно выразить через два криволинейных интеграла II рода:

$$\int_{t_1}^{t_2} f(z(t)) z'(t) dt = \int_{\gamma} (udx - vdy) + i \int_{\gamma} (vdx + udy), \quad (22.2)$$

B.9.1. Свойства комплексного интеграла

Свойства интеграла комплекснозначной функции по кривой:

- Линейность: если $c_1, c_2 \in \mathbb{C}$ и функции f_1, f_2 непрерывны на кривой γ , то

$$\int_{\gamma} (c_1 f_1(z) + c_2 f_2(z)) dz = c_1 \int_{\gamma} f_1(z) dz + c_2 \int_{\gamma} f_2(z) dz. \quad (22.3)$$

- Аддитивность по кривой интегрирования: если кривая γ разбита на две части γ_1 и γ_2 и $\gamma = \gamma_1 \cup \gamma_2$, то

$$\int_{\gamma} f(z) dz = \int_{\gamma_1} f(z) dz + \int_{\gamma_2} f(z) dz. \quad (22.4)$$

- Не зависит от параметризации кривой.
- При изменении ориентации кривой знак интеграла меняется на противоположный:

$$\int_{-\gamma} f(z) dz = - \int_{\gamma} f(z) dz. \quad (22.5)$$

- Оценка модуля интеграла:

$$\left| \int_{\gamma} f(z) dz \right| \leq \int_{t_1}^{t_2} |f(z(t))| \cdot \sqrt{(x'(t))^2 + (y'(t))^2} dt := \int_{\gamma} |f(z)| |dz|. \quad (22.6)$$

- Пусть $\ell(\gamma)$ – длина кривой. Если $\forall z \in \gamma : |f(z)| \leq M < \infty$, то

$$\left| \int_{\gamma} f(z) dz \right| \leq M \cdot \ell(\gamma). \quad (22.7)$$

Пример. Пусть $a \in \mathbb{C}$. Рассмотрим кривую $\gamma_r = \{z : |z - a| = r\}$, где $r > 0$, ориентированную против часовой стрелки. Вычислим интеграл

$$\int_{\gamma_r} (z - a)^k dz. \quad (22.8)$$

Параметризуем кривую: $z(t) = a + re^{i\varphi}$, $\varphi \in [0, 2\pi]$. Тогда

$$\begin{aligned} \int_{\gamma_r} (z - a)^k dz &= \int_0^{2\pi} (re^{i\varphi})^k i re^{i\varphi} d\varphi = ir^{k+1} \int_0^{2\pi} e^{i(k+1)\varphi} d\varphi = \\ &= \begin{cases} 0, & \text{если } k \neq -1 \\ 2\pi i, & \text{если } k = -1. \end{cases} \end{aligned} \quad (22.9)$$

то есть

$$\int_{\gamma_r} \frac{dz}{z - a} = 2\pi i. \quad (22.10)$$

B.9.2. Теорема о почленном интегрировании

 **Теорема.** Пусть $f_n : \gamma \rightarrow \mathbb{C}$ и f_n непрерывны на кусочно-гладкой кривой γ и ряд $\sum_{k=0}^{+\infty}$ сходится на γ равномерно к $s(z)$. Тогда его можно почленно интегрировать, то есть

$$\int_{\gamma} s(z) dz = \sum_{n=0}^{+\infty} \int_{\gamma} f_n(z) dz. \quad (22.11)$$

Доказательство. \square Так как f_n непрерывны, и ряд сходится равномерно, то f непрерывна на $\gamma \Rightarrow$ интеграл $\int_{\gamma} f(z) dz$ определён. По определению равномерной сходимости, $\forall \varepsilon > 0 \exists N_{\varepsilon} \in \mathbb{N} : \forall n \geq N_{\varepsilon} \forall z \in \gamma$:

$$\left| s(z) - \sum_{n=0}^N f_n(z) \right| < \varepsilon \quad (22.12)$$

Напишем разницу между интегралом и частичной суммой интегралов:

$$\left| \int_{\gamma} s(z) dz - \sum_{n=0}^N \int_{\gamma} f_n(z) dz \right| = \left| \int_{\gamma} \left(s(z) - \sum_{n=0}^N f_n(z) \right) dz \right| \leq \int_{\gamma} \left| s(z) - \sum_{n=0}^N f_n(z) \right| |dz| \quad (22.13)$$

■

Определение. Область $G \subset \mathbb{C}$ называется односвязной, если любая замкнутая кривая, лежащая в G , может быть стянута до точки внутри G . Ещё можно определить так: если есть ограниченная область D и кусочно-гладкий контур γ такой, что $\partial D = \gamma$ и $\gamma \subset G$, то $D \subset G$.

B.9.3. Интегральная теорема Коши

 **Теорема.** Пусть $f : G \rightarrow \mathbb{C}$ регулярна в односвязной области G и $\gamma \subset G$ – простой кусочно-гладкий контур (замкнутая кривая). Тогда

$$\int_{\gamma} f(z) dz = 0. \quad (22.14)$$

Доказательство. □ Пусть $f(z) = u(x, y) + iv(x, y)$, где $u, v : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$. Тогда по определению комплексного интеграла

$$\int_{\gamma} f(z) dz = \int_{\gamma} (udx - vdy) + i \int_{\gamma} (vdx + udy). \quad (22.15)$$

Так как $f(z)$ регулярна, то u, v имеют непрерывные частные производные. По формуле Грина:

$$\int_{\gamma} (udx - vdy) = \iint_D \left(-\frac{\partial v}{\partial x} - \frac{\partial u}{\partial y} \right) dx dy = 0, \quad (22.16)$$

$$\int_{\gamma} (vdx + udy) = \iint_D \left(\frac{\partial u}{\partial y} - \frac{\partial v}{\partial x} \right) dx dy = 0. \quad (22.17)$$

Следовательно, из условий Коши-Римана, $\int_{\gamma} f(z) dz = 0$. Здесь использована непрерывная дифференцируемость u и v , которая включается в регулярность f . ■

Определение. Область $G \subset \mathbb{C}$ называется областью с кусочно-гладкой границей, если границу можно представить в виде конечного объединения кусочно-гладких кривых, которые могут иметь общие точки только на концах.

Определение. Кривая γ_k называется разрезом, если $\forall z \in \mathring{\gamma}(\gamma_k$ без концевых точек) $\exists \varepsilon > 0 : B_\varepsilon(z) \setminus \gamma_k \subset G$.

B.9.4. Обобщённая теорема Коши и интегральная формула Коши

 *Теорема (б/д).* Пусть G – ограниченная область с кусочно-гладкой положительно ориентированной границей γ , а функция f регулярна в G и непрерывна на \overline{G} . Тогда

$$\int_{\gamma} f(z) dz = 0. \quad (22.18)$$

Используя эту теорему, можно вывести интегральную формулу Коши.

 *Теорема.* Пусть G – ограниченная область с кусочно-гладкой положительно ориентированной границей γ , а функция f регулярна в G и непрерывна на \overline{G} . Тогда $\forall z \in G$ выполняется формула Коши:

$$f(z) = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma} \frac{f(\zeta) d\zeta}{\zeta - z}. \quad (22.19)$$

Доказательство. \square Если $z \in G$, то существует такой радиус $r_0 > 0$, что круг $\overline{B}_{r_0}(z) \subset G$. Рассмотрим контур $\gamma_r = \{\zeta : |\zeta - z| = r\}$, ориентированный против часовой стрелки. По обобщённой теореме Коши интеграл по замкнутому контуру γ равен сумме интегралов по контурам γ и $-\gamma_r$:

Пусть $0 < r < r_0$ и $G_r = G \setminus \overline{B}_r(z)$. Тогда $\frac{f(\zeta)}{\zeta - z}$ регулярна в $\overline{G_r}$, и по интегральной теореме Коши:

$$\int_{\partial\gamma_r} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} d\zeta = \int_{\Gamma} \frac{f(z)}{\zeta - z} d\zeta + \int_{\gamma_r^-} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} d\zeta. \quad (22.20)$$

Итак,

$$\frac{1}{2\pi i} \int_{\Gamma} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} d\zeta = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r^-} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} d\zeta. \quad (22.21)$$

$$\frac{1}{2\pi i} \int_{\Gamma} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} d\zeta - f(z) = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r^-} \frac{f(\zeta) - f(z)}{\zeta - z} d\zeta. \quad (22.22)$$

Так как f регулярна в G , то она непрерывна в z . Следовательно, $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 : |z - \zeta| < \delta \Rightarrow |f(z) - f(\zeta)| < \varepsilon$.

$$\left| \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} d\zeta - f(z) \right| \leq \left| \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r} \frac{|f(\zeta) - f(z)|}{|\zeta - z|} |d\zeta| \right| < \frac{1}{2\pi} \frac{\varepsilon}{r} 2\pi r = \varepsilon. \frac{1}{2\pi} \int_{\gamma_r} \frac{\varepsilon}{r} |d\zeta| \quad (22.23)$$

■

Определение. Пусть γ – кусочно-гладкая кривая в комплексной плоскости, а функция g непрерывна на γ . Тогда функция $I(z)$ называется интегралом типа Коши от функции g по кривой γ :

$$I(z) = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma} \frac{g(\zeta)}{\zeta - z} d\zeta \quad (22.24)$$

 *Теорема.* В условиях данного определения функция I является бесконечно дифференцируемой и

$$I^{(n)}(z) = \frac{n!}{2\pi i} \int_{\gamma} \frac{g(\zeta)}{(\zeta - z)^{n+1}} d\zeta, \quad n \in \mathbb{N}. \quad (22.25)$$

 *Теорема.* Если функция $f : G \rightarrow \mathbb{C}$ регулярна на области G , то она бесконечно дифференцируема на области G .

Доказательство. □ Пусть $z \in G$. Тогда существует такой радиус $r > 0$, что $\overline{B}_r(z) \subset G$. По интегральной формуле Коши

$$f(z) = \frac{1}{2\pi i} \int_{\partial B_r(z)} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} d\zeta. \quad (22.26)$$

отсюда следует, что f бесконечно дифференцируема в открытом круге $B_r(z)$, так как интеграл типа Коши бесконечно дифференцируем. Поскольку z – произвольная точка области G , то f бесконечно дифференцируема на всей области G . ■

B.10. Ряд Тейлора и ряд Лорана

B.10.1. Ряд Тейлора

Определение. Пусть функция f бесконечно дифференцируема в окрестности точки a . Тогда степенной ряд вида

$$\sum_{n=0}^{+\infty} \frac{f^{(n)}(a)}{n!} \cdot (x - a)^n \quad (23.1)$$

называется рядом Тейлора функции f в точке a .

его радиус сходимости определяется согласно теореме Коши-Адамара и равен

$$R = \frac{1}{\limsup_{n \rightarrow +\infty} \left(\frac{|f^{(n)}(a)|}{n!} \right)^{\frac{1}{n}}}, \quad (23.2)$$

причём на границе круга сходимости ряд может сходиться или расходиться.

 **Теорема.** Пусть $r > 0$. Если f регулярна в $B_r(a)$, то ряд Тейлора функции f в точке a сходится к $f(x)$ внутри области $B_r(a)$.

Доказательство. \square Пусть $z \in B_r(a)$ и $|z - a| < r_1 < r$ так, что $z \in B_{r_1}(a)$. По интегральной формуле Коши:

$$f(z) = \frac{1}{2\pi i} \int_{\partial B_{r_1}(a)} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} d\zeta. \quad (23.3)$$

Так как $|z - a| < |\zeta - a| = r_1$, то $\left| \frac{z-a}{\zeta-a} \right| < 1$. Разложим в ряд Тейлора дробь:

$$\frac{1}{\zeta - z} = \frac{1}{(\zeta - a) - (z - a)} = \frac{1}{\zeta - a} \cdot \frac{1}{1 - \frac{z-a}{\zeta-a}} = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{(z-a)^n}{(\zeta-a)^{n+1}}. \quad (23.4)$$

Итак,

$$\begin{aligned} f(z) &= \frac{1}{2\pi i} \int_{\partial B_{r_1}(a)} f(\zeta) \cdot \left(\sum_{n=0}^{+\infty} \frac{(z-a)^n}{(\zeta-a)^{n+1}} \right) d\zeta = \\ &= \sum_{n=0}^{+\infty} \left(\frac{1}{2\pi i} \int_{\partial B_{r_1}(a)} \frac{f(\zeta)}{(\zeta-a)^{n+1}} d\zeta \right) \cdot (z-a)^n. \end{aligned} \quad (23.5)$$

$\int \sum = \sum \int$, так как ряд сходится равномерно, что можно установить по признаку Вейерштрасса. По формуле Коши для производных

$$f^{(n)}(a) = \frac{n!}{2\pi i} \int_{\partial B_{r_1}(a)} \frac{f(\zeta)}{(\zeta - a)^{n+1}} d\zeta. \quad (23.6)$$

■

Теорема ($\tilde{\partial}/\partial$). Сумма степенного ряда в открытом круге сходимости $B_r(a)$ является регулярной функцией и его можно почленно дифференцировать любое число раз.

В.10.2. Теорема Лиувилля и основная теорема алгебры *

Сформулируем и докажем теорему Лиувилля, и вслед за ней основную теорему алгебры.

Теорема. Если функция f регулярна в \mathbb{C} и ограничена в некоторой окрестности бесконечности, то f — константа.

Замечание. Ограничность в окрестности бесконечности эквивалентна просто ограниченности в \mathbb{C} : $\exists M > 0 : \forall z \in \mathbb{C} : |f(z)| \leq M < +\infty$.

Доказательство. □ Запишем ряд Маклорена функции f :

$$f(z) = \sum_{n=0}^{+\infty} c_n \cdot z^n. \quad (23.7)$$

Пусть γ_r — окружность радиуса r с центром в нуле. Тогда $\forall r > 0$:

$$c_n = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r} \frac{f(\zeta)}{\zeta^{n+1}} d\zeta. \quad (23.8)$$

Оценим член ряда:

$$\begin{aligned} c_n &\leq \frac{1}{2\pi} \int_{\gamma_r} \frac{|f(\zeta)|}{|\zeta|^{n+1}} |d\zeta| \leq \\ &\leq \frac{1}{2\pi} \int_{\gamma_r} \frac{M}{r^{n+1}} |d\zeta| = \frac{M}{r^n} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0. \end{aligned} \quad (23.9)$$

Отсюда следует, что $c_n = 0$ при $n \geq 1$, то есть $f(z) \equiv c_0$, где c_0 — константа. ■

Основная теорема алгебры. Любой многочлен $P(z) = a_n z^n + a_{n-1} z^{n-1} + \dots + a_1 z + a_0 \in \mathbb{C}[z]$, где $a_n \neq 0$ и $n \geq 1$, имеет хотя бы один корень в \mathbb{C} .

Доказательство. \square Предположим, что многочлен $P(z)$ не имеет корней в \mathbb{C} . Тогда функция $f(z) = \frac{1}{P(z)}$ регулярна во всей комплексной плоскости. При этом при $|z| \rightarrow +\infty$ мы получим, что $f(z) \rightarrow 0$, а из сходимости следует, что $f(z)$ ограничена. По теореме Лиувилля, $f(z)$ — константа. Но тогда $P(z)$ — константа, что противоречит условию о том, что $\deg P > 0$. ■

Следствие. Любой многочлен $P \in \mathbb{C}[z]$, при $\deg P = n > 0$, имеет ровно n корней в \mathbb{C} .

B.10.3. Ряд Лорана

Определение. Выражение

$$\sum_{n=-\infty}^{+\infty} c_n \cdot (z-a)^n \quad (23.10)$$

называется рядом Лорана с центром в точке a , если существует такое $r > 0$, что ряд сходится при $0 < |z-a| < r$.

Эта формальная сумма понимается как сумма двух рядов:

$$\sum_{n=0}^{+\infty} c_n \cdot (z-a)^n + \sum_{n=1}^{+\infty} c_{-n} \cdot (z-a)^{-n}, \quad (23.11)$$

что не следует путать с суммированием в смысле главного значения.

Первый ряд — степенной, он сходится при $|z-a| < R$ для некоторого $R > 0$. Во втором ряду можно сделать замену $\zeta = \frac{1}{z-a}$, тогда он сходится при $|\zeta| < \alpha_0$, то есть при $|z-a| < \frac{1}{\alpha_0} = \rho$.

Итак, ряд Лорана сходится в кольце(геометрически!) $\rho < |z-a| < R$.

Если вдруг $\rho > R$, то ряд Лорана не сходится нигде, кроме как в точке a . Кроме того, если $\rho < r_1 < r_2 < R$, то во внутреннем кольце $r_1 < |z-a| < r_2$ ряд Лорана сходится равномерно.

 **Теорема.** Пусть функция f регулярна в кольце $\rho < |z-a| < R$. Тогда в этом кольце она раскладывается в ряд Лорана $\sum_{n=-\infty}^{+\infty} c_n \cdot (z-a)^n$, причём

$$c_n = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r} \frac{f(\zeta)}{(\zeta-a)^{n+1}} d\zeta, \quad r \in (\rho, R), \quad (23.12)$$

где γ_r — окружность радиуса r с центром в точке a , ориентированная против часовой стрелки.

Доказательство. \square Пусть $\rho < r_1 < r_2 < R$. Тогда по обобщённой теореме Коши, если функция регулярна в области G и непрерывна на её замыкании, то:

$$\int_{\partial G} f(z) dz = 0. \quad (23.13)$$

Применим эту теорему к кольцу $r_1 < |z - a| < r_2$. Пусть z — точка из этого кольца, причём $\frac{f(\zeta)}{(\zeta - a)^{n+1}}$ регулярна в нём и непрерывна на его замыкании. Тогда

$$\int_{\gamma_{r_2}} \frac{f(\zeta)}{(\zeta - a)^{n+1}} d\zeta - \int_{\gamma_{r_1}} \frac{f(\zeta)}{(\zeta - a)^{n+1}} d\zeta = 0. \quad (23.14)$$

Мы всегда можем подобрать два радиуса r_1 и r_2 , так, чтобы внутреннее кольцо содержало точку z . Тогда по интегральной формуле Коши:

$$f(z) = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_{r_2}} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} d\zeta - \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_{r_1}} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} d\zeta = I_2 + I_1. \quad (23.15)$$

$$\begin{aligned} \frac{1}{2\pi i} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} &= \frac{1}{2\pi i} \frac{f(\zeta)}{(\zeta - a) - (z - a)} = \frac{1}{2\pi i} \frac{f(\zeta)}{\zeta - a} \cdot \frac{1}{1 - \frac{z-a}{\zeta-a}} = \\ &= \frac{1}{2\pi i} \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{f(\zeta)}{(\zeta - a)^{n+1}} \cdot (z - a)^n. \end{aligned} \quad (23.16)$$

Этот ряд сходится равномерно на γ_{r_2} по признаку Вейерштрасса. Действительно, пусть $q = \frac{|z-a|}{|\zeta-a|} < 1$. Тогда $|f(\zeta)| \leq \max_{\zeta \in \gamma_{r_2}} |f(\zeta)| = M_2$. Регулярная функция непрерывна, и потому ограничена на компакте. Тогда

$$\left| \frac{f(\zeta)}{(\zeta - a)^{n+1}} \cdot (z - a)^n \right| \leq \frac{M_2}{r_2^{n+1}} \cdot |z - a|^n = \frac{M_2}{r_2} \cdot q^n, \quad (23.17)$$

то есть мы оценили ряд сходящимся геометрическим рядом. Таким образом, можно почленно интегрировать:

$$\begin{aligned} I_2 &= \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_{r_2}} \left(\sum_{n=0}^{+\infty} \frac{f(\zeta)}{(\zeta - a)^{n+1}} \cdot (z - a)^n \right) d\zeta = \\ &= \sum_{n=0}^{+\infty} \left(\frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_{r_2}} \frac{f(\zeta)}{(\zeta - a)^{n+1}} d\zeta \right) \cdot (z - a)^n. \end{aligned} \quad (23.18)$$

Пусть теперь $\zeta \in \gamma_{r_1}$, тогда $|\zeta - a| = r_1$, и мы можем записать:

$$\begin{aligned}
-\frac{1}{2\pi i} \frac{f(\zeta)}{\zeta - z} &= \frac{1}{2\pi i} \frac{f(\zeta)}{(z-a) - (\zeta-a)} = \\
&= \frac{1}{2\pi i} \frac{f(\zeta)}{z-a} \cdot \frac{1}{1 - \frac{\zeta-a}{z-a}}.
\end{aligned} \tag{23.19}$$

Теперь $\frac{|\zeta-a|}{|z-a|} < 1$, и потому ряд $\sum_{n=0}^{+\infty} \frac{f(\zeta)}{(z-a)^{n+1}} \cdot (\zeta-a)^n$ сходится равномерно на γ_{r_1} по признаку Вейерштрасса. Почленно интегрируя, получаем:

$$\begin{aligned}
I_1 &= \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_{r_1}} \left(\sum_{n=0}^{+\infty} f(\zeta) \cdot (\zeta-a)^n \cdot \frac{1}{(z-a)^{n+1}} \right) d\zeta = \\
&= \sum_{n=0}^{+\infty} \left(\frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_{r_1}} \frac{f(\zeta)}{(\zeta-a)^n} d\zeta \right) \cdot \frac{1}{(z-a)^{n+1}}.
\end{aligned} \tag{23.20}$$

После смены индексов суммирования в ряду получаем:

$$I_1 = \sum_{n=-\infty}^{-1} \left(\frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_{r_1}} \frac{f(\zeta)}{(\zeta-a)^{n+1}} d\zeta \right) \cdot (z-a)^n. \tag{23.21}$$

Таким образом, получаем:

$$f(z) = \sum_{n=-\infty}^{+\infty} c_n \cdot (z-a)^n, \tag{23.22}$$

где

$$c_n = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r} \frac{f(\zeta)}{(\zeta-a)^{n+1}} d\zeta, r \in (\rho, R). \tag{23.23}$$

■

Следствие. Если функция f регулярна в круге $B_r(a)$, то её ряд Лорана в этой области совпадает с рядом Тейлора, то есть $c_n = 0$ при $n < 0$.

Доказательство следствия. □ Пусть $\rho = 0$. Тогда при $n < 0$ и любом $r \in (0, R)$:

$$c_n = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r} \frac{f(\zeta)}{(\zeta-a)^{n+1}} d\zeta = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r} f(\zeta)(\zeta-a)^{k+1} d\zeta = 0, \tag{23.24}$$

где $k > 0$, и этот интеграл равен нулю по теореме Коши, так как функция $f(\zeta)(\zeta-a)^k$ регулярна в шаре. ■

█ **Теорема.** Если функция f регулярна в кольце $\rho < |z - a| < R$, то её представление в виде ряда Лорана единственное.

Доказательство. □ Пусть $f(z) = \sum_{n=-\infty}^{+\infty} c_n(z-a)^n$, где

$$c_n = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r} \frac{f(\zeta)}{(\zeta-a)^{n+1}} d\zeta. \quad (23.25)$$

Поделим на $2\pi i(z-a)^{k+1}$:

$$\frac{1}{2\pi i} \frac{f(z)}{(z-a)^{k+1}} = \frac{1}{2\pi i} \sum_{n=-\infty}^{+\infty} c_n \cdot (z-a)^{n-(k+1)}. \quad (23.26)$$

На любом кольце внутри исходного ряд Лорана сходится равномерно, то можно его проинтегрировать по окружности. Итак,

$$\frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r} \frac{f(z)}{(z-a)^{k+1}} dz = \frac{1}{2\pi i} \sum_{n=-\infty}^{+\infty} c_n \int_{\gamma_r} \frac{dz}{(z-a)^{k+1-n}} \quad (23.27)$$

Так как при $m \neq -1 \int_{\gamma_r} \frac{dz}{(z-a)^m} = 0$, то выживает только слагаемое с $n = k$, где интеграл равен $2\pi i$. Поэтому разложение единственное, так как слева написан коэффициент ряда Лорана. ■

Следствие. Если f регулярна в $B_r(a)$, то её разложение в степенной ряд по степеням $(z-a)$ единственное и совпадает с рядом Тейлора.

B.10.4. Неравенство Коши для коэффициентов ряда Лорана

Если функция f регулярна в кольце $\rho < |z - a| < R$ и $|f(z)| \leq A_r \forall z : |z - a| = r$ и $r \in (\rho, R)$. Тогда для коэффициентов ряда Лорана справедлива следующая оценка:

$$|c_n| \leq \frac{A_r}{r^n} \quad (23.28)$$

Доказательство. □ Оценим коэффициенты, используя формулу для них через интеграл:

$$c_n \leq \frac{1}{2\pi} \int_{\gamma_r} \frac{|f(\zeta)|}{|\zeta - a|^{n+1}} |d\zeta| \leq \frac{1}{2\pi} \frac{A_r}{r^{n+1}} 2\pi r = \frac{A_r}{r^n}. ■ \quad (23.29)$$

B.11. Изолированные особые точки и вычеты

Определение. Точка $a \in \overline{\mathbb{C}}$ называется изолированной особой точкой (однозначного характера) функции f , если f не является регулярной в точке a или не определена в ней, но регулярна в некоторой проколотой окрестности точки a .

В проколотой окрестности $\mathring{B}_r(a)$ точки a можно разложить функцию в ряд Лорана, так как это кольцо. Рассмотрим 2 случая:

- Пусть $a \in \mathbb{C}$. Тогда $\forall z \in \mathring{B}_r(a)$:

$$f(z) = \underbrace{\sum_{n=0}^{+\infty} c_n (z-a)^n}_{\text{правильная часть}} + \underbrace{\sum_{n=-\infty}^{-1} c_n (z-a)^n}_{\text{главная часть}}, \quad (24.1)$$

часть с положительными индексами называется правильной, а с отрицательными — главной.

- Если $a = \infty$ это изолированная особая точка, то f регулярна в множестве $G = \{z : |z| > \rho \geq 0\}$, и тогда $\forall z \in G$:

$$f(z) = \underbrace{\sum_{n=-\infty}^0 c_n z^n}_{\text{правильная часть}} + \underbrace{\sum_{n=1}^{+\infty} c_n z^n}_{\text{главная часть}} \quad (24.2)$$

B.11.1. Классификация ИОТ

Определение. Пусть $a \in \mathbb{C}$ — изолированная особая точка функции f . Тогда

- a называется устранимой особой точкой, если $\exists \lim_{z \rightarrow a} f(z) \in \mathbb{C}$. (УОТ)
- a называется полюсом, если $\lim_{z \rightarrow a} f(z) = \infty$.
- a называется существенно особой точкой, если $\nexists \lim_{z \rightarrow a} f(z)$ ни конечного, ни бесконечного. (СОТ)

■ **Теорема.** Пусть $a \in \overline{\mathbb{C}}$ – изолированная особая точка. Тогда

1. для того, чтобы a была УОТ, необходимо и достаточно, чтобы главная часть ряда Лорана была нулевой
2. для того, чтобы a была полюсом, необходимо и достаточно, чтобы главная часть ряда Лорана содержала конечное ($\neq 0$) число слагаемых
3. для того, чтобы a была СОТ, необходимо и достаточно, чтобы главная часть ряда Лорана содержала бесконечно много слагаемых.

Если $a \in \mathbb{C}$ – УОТ, то при доопределении функции f в точке a пределом в точке a функция становится регулярной.

Доказательство. □ Пусть f регулярна в $\mathring{B}_\rho(a)$.

1. Необходимость для УОТ, то есть если a – УОТ, то $c_n = 0$ при $n < 0$. Устранимая особая точка означает, что существует конечный предел в точке a , значит функция f ограничена в некоторой проколотой окрестности: $\exists M > 0 : \forall z \in \mathring{B}_{\delta_1}(a) \setminus \{a\} \quad |f(z)| \leq M$. Если $r < \min\{\rho_1, \rho\}$. Согласно неравенству Коши для коэффициентов ряда Лорана:

$$|c_n| \leq \frac{M}{r^n} \xrightarrow[r \rightarrow +0]{} 0 \Rightarrow c_n = 0. \quad (24.3)$$

2. Достаточность для УОТ. Мы знаем, что главная часть ряда Лорана равна нулю, то есть

$$f(z) = \sum_{n=0}^{+\infty} c_n (z-a)^n \quad (\forall z \in \mathring{B}_\rho(a)) \quad (24.4)$$

сумма степенного ряда $s(z)$ является регулярной функцией, поэтому она непрерывна в точке a .

$$\exists \lim_{z \rightarrow a} s(z) = c_0 \quad (24.5)$$

Но $s(z) = f(z)$ при $z \in \mathring{B}_\rho(a)$. Поэтому f тоже имеет предел в точке a и поэтому a – УОТ. Кроме того, доопределенная функция f в точке предела становится регулярной.

3. Необходимость для полюса. Если a – полюс, то $\lim_{z \rightarrow a} f(z) = \infty \Rightarrow \exists \delta > 0 : \forall z \in \mathring{B}_\delta(a) \setminus \{a\} \quad |f(z)| > 1$. Рассмотрим функцию $g(z) = \frac{1}{f(z)}$. Она определена и регулярна в $\mathring{B}_\delta(a)$. Кроме того, $\lim_{z \rightarrow a} g(z) = 0$. Поэтому $z = a$ – УОТ функции g , поэтому по

доказанному ранее, главная часть ряда Лорана функции g равна нулю, то есть её ряд Лорана будет рядом Тейлора при доопределении нулём функции g в точке a . Так как предел равен нулю, то свободный член $c_0 = 0$ и $g(z) \not\equiv 0$.

Пусть $c_m \neq 0$ – коэффициент, отличный от нуля с наименьшим номером, $m \in \mathbb{N}$. Тогда

$$\begin{aligned} g(z) &= c_m(z-a)^m + c_{m+1}(z-a)^{m+1} + \dots = \\ &= (z-a)^m(c_m + c_{m+1}(z-a) + c_{m+2}(z-a)^2 + \dots) \end{aligned} \tag{24.6}$$

этот степенной ряд $h(z)$ сходится в $\dot{B}_\delta(a)$ и самой точке a . Поэтому функция g регулярна $B_\delta(a)$ по теореме о регулярности суммы степенного ряда. Так как $h(a) \neq 0$, то $\frac{1}{h(z)}$ регулярна в некоторой $B_{\rho_1}(a)$. Из регулярности $\frac{1}{h(z)}$ следует, что её можно разложить в ряд Тейлора:

$$\frac{1}{h(z)} = d_0 + d_1(z-a) + d_2(z-a)^2 + \dots \tag{24.7}$$

Итак,

$$f(z) = \frac{1}{g(z)} = \frac{1}{(z-a)^m h(z)} = \frac{d_0}{(z-a)^m} + \frac{d_1}{(z-a)^{m-1}} + \dots + \frac{d_{m-1}}{z-a} + d_m + d_{m+1}(24.8) + \dots$$

то есть в ряде Лорана лишь конечное число слагаемых главной части.

4. Достаточность для полюса. Пусть нам известно, что

$$\begin{aligned} f(z) &= c_{-m}(z-a)^{-m} + c_{-m+1}(z-a)^{-m+1} + \dots + c_0 + c_1(z-a) + \dots = \\ &= \frac{1}{(z-a)^m}(c_{-m} + c_{-m+1}(z-a) + \dots) \end{aligned} \tag{24.9}$$

сумма степенного ряда в скобках регулярна \Rightarrow непрерывна, и поэтому стремится к $c_{-m} \neq 0$ при $z \rightarrow a$. Поэтому $f(z) \rightarrow \infty$.

5. Необходимость и достаточность для СОТ доказывается методом исключения: для изолированной особой точки существует 3 вида, и для ряда Лорана 3, причём между ними установлено взаимно-однозначное соответствие. Поэтому для случая 3 утверждение доказано.
6. Если $a = \infty$. Сделаем замену $\zeta = \frac{1}{z}$. Рассмотрим функцию $\tilde{f}(\zeta) = f\left(\frac{1}{\zeta}\right)$. Если $z \rightarrow \infty$, то $\zeta \rightarrow 0$. Вид ИОТ у них одинаковый, а главные части ряда Лорана совпадают.



B.11.2. Критерий полюса

 **Теорема.** Точка $a \in \mathbb{C}$ является полюсом функции f тогда и только тогда, когда $\exists B_\rho(a), m \in \mathbb{N} : f$ регулярна в этой окрестности и функция $p : p(a) \neq 0$ и f можно представить в виде:

$$f(z) = \frac{p(z)}{(z - a)^m}. \quad (24.10)$$

\Rightarrow доказано в теореме выше, \Leftarrow очевидно.

 **Теорема.** Точка $a = \infty$ является полюсом функции f тогда и только тогда, когда $\exists B_\rho(\infty), m \in \mathbb{N} : f$ регулярна в этой окрестности и функция $p : p(\infty) \neq 0$ и f можно представить в виде:

$$f(z) = z^m p(z). \quad (24.11)$$

Определение. Если $a \in \overline{\mathbb{C}}$ – полюс функции f , то число m из формулировок выше называется порядком полюса.

Фактически, порядок определяется номером первого ненулевого коэффициента главной части ряда Лорана.

B.11.3. Полюс частного функций

Определение. Если f регулярна в точке a , то a называется нулём m -того порядка, если $f(a) = f'(a) = \dots = f^{(n-1)}(a) = 0 \neq f^{(n)}(a)$. Если $f(a) \neq 0$, то такая точка называется нулём нулевого порядка.

Если a – нуль m -го порядка регулярной функции f , то в ряде Тейлора первые m коэффициентов нулевые: $c_0 = c_1 = \dots = c_{m-1}$

$$\begin{aligned} f(z) &= c_n(z - a)^m + c_{m+1}(z - a)^{m+1} + \dots = \\ &= (z - a)^m(c_m + c_{m+1}(z - a) + \dots) \end{aligned} \quad (24.12)$$

где в скобках стоит степенной ряд, сходящийся в окрестности точки a . Итак, $f(z) = (z - a)^m \tilde{f}(z)$, где \tilde{f} регулярна в точке a и отлична в ней от нуля.

 **Предложение.** Если g и h регулярны в точке $a \in \mathbb{C}$, а – нуль порядка $m \in \mathbb{N}$ функции g и a – нуль порядка $k \in \mathbb{N}_0$ функции h . Тогда

1. если $m > k$, то a – полюс порядка $m - k$ функции $f(z) = h(z)/g(z)$.
2. если $m \leq k$, то a – устранимая особая точка функции $f(z)$.

Доказательство. \square $g(z) = (z - a)^m \tilde{g}(z)$ и $h(z) = (z - a)^k \tilde{h}(z)$, где g, h регулярны в точке a и $g(a) \neq 0 \neq h(a)$. Тогда

$$f(z) = \frac{(z - a)^k}{(z - a)^m} \cdot \frac{\tilde{h}(z)}{\tilde{g}(z)} = (\tilde{f}(z)) \quad (24.13)$$

1. если $m > k$, то $f(z) = \frac{\tilde{f}(z)}{(z-a)^{m-k}}$ – необходимое и достаточное условие полюса порядка $m - k$.
2. Если $m \leq k$, то $f(z) = (z - a)^{k-m} \tilde{f}(z)$, при $z \rightarrow a$ получается устранимая особая точка.

■

B.11.4. Теория вычетов

Определение. Пусть $a \in \mathbb{C}$ – изолированная особая точка функции f и f регулярна в $\dot{B}_\rho(a)$ и $r \in (0, \rho)$ и задана окружность $\gamma_r^\circlearrowleft = \{z : |z - a| = r\}$, ориентированная против часовой стрелки. Тогда вычетом функции f в точке a называется следующий интеграл:

$$\operatorname{Res}_a f := \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_r} f(z) dz. \quad (24.14)$$

Этот интеграл не зависит от r , так как $\operatorname{Res}_a f = c_{-1}$ – коэффициент в ряде Лорана функции f .

Утверждение. Если $a \in \mathbb{C}$ – УОТ функции f , то $\operatorname{Res}_a f = 0$.

Доказательство. \square Главная часть ряда Лорана функции f в УОТ равна нулю, поэтому $\operatorname{Res}_a f = c_{-1} = 0$. ■

Утверждение (вычет в полюсе). Если $a \in \mathbb{C}$ – полюс порядка n функции f , то вычет в нём равен

$$\operatorname{Res}_a f = \frac{1}{(m-1)!} \cdot \lim_{z \rightarrow a} \frac{d^{m-1}}{dz^{m-1}} (f(z)(z - a)^m) \quad (24.15)$$

Доказательство. \square Пусть a – полюс порядка m , тогда f в $\dot{B}_\rho(a)$ можно разложить в ряд Лорана:

$$f(z) = c_{-m}(z - a)^{-m} + \dots + c_{-1}(z - a)^{-1} + c_0 + c_1(z - a) + \dots \quad (24.16)$$

Домножим на $(z - a)^m$:

$$f(z)(z - a)^m = c_{-m} + c_{-m+1}(z - a) + \dots + c_{-1}(z - a)^{m-1} + c_0(z - a)^m + \dots \quad (24.17)$$

в проколотой окрестности точки a . Возьмём производную $(m - 1)$ -го порядка, это можно сделать, так как степенной ряд можно почленно дифференцировать.

$$\frac{d^{m-1}}{dz^{m-1}}(f(z)(z-a)^m) = 0 + (m-1)! \cdot c_{-1} + (m-1)! \cdot c_0(z-a) + \dots \quad (24.18)$$

перейдём к пределу при $z \rightarrow a$ и получим $c_{-1}(m-1)!$, поэтому требуемое доказано. ■

Следствие. Пусть P, Q регулярны в точке a , причём $P(a) \neq 0, Q(a) = 0, Q'(a) \neq 0$. Тогда

$$\operatorname{Res}_a \frac{P(z)}{Q(z)} = \frac{P(a)}{Q'(a)}. \quad (24.19)$$

Доказательство. □ Пусть $f = \frac{P(z)}{Q(z)}$. Тогда

$$\operatorname{Res}_a f = \lim_{z \rightarrow a} (z-a) \frac{P(z)}{Q(z)} = \lim_{z \rightarrow a} \frac{(z-a)P(z)}{Q(z)-Q(a)} = \frac{P(a)}{Q'(a)}. \quad (24.20)$$

■
Например, вычет функции $f(z) = \frac{z}{(z-1)(z-2)^2}$. Здесь $P(z) = \frac{z}{(z-2)^2}, Q(z) = (z-1)$.

$$\operatorname{Res}_1 f = \frac{P(1)}{Q'(1)} = \frac{1}{1} = 1. \quad (24.21)$$

Если мы хотим вычет в точке $z = 2$, то используем формулу с производной высшего порядка:

$$\operatorname{Res}_2 f = \lim_{z \rightarrow 2} \frac{1}{1!} \left[(z-2)^2 \cdot \frac{z}{(z-1)(z-2)^2} \right]' = \lim_{z \rightarrow 2} \frac{z-1-z}{(z-1)^2} = -1. \quad (24.22)$$

Определение. Пусть f регулярна в шаре $\overset{\circ}{B}_{R_0}(\infty)$. Тогда вычетом функции f в бесконечности называется число

$$\operatorname{Res}_\infty f = \frac{1}{2\pi i} \int_{\gamma_R^{-1}} f(z) dz, \text{ где } R > R_0. \quad (24.23)$$

причём окружность γ_R^{-1} ориентирована по часовой стрелке, $\gamma_R = \{z : |z| = R\}$.

Вычет в бесконечности противоположен по знаку минус первому коэффициенту в ряде Лорана

$$\operatorname{Res}_\infty f = -c_{-1}. \quad (24.24)$$

Утверждение. Если ∞ – устранимая особая точка функции f и $f(00) = \lim_{z \rightarrow \infty} f(z)$, то

$$\operatorname{Res} f = \lim_{z \rightarrow \infty} z(f(\infty) - f(z)). \quad (24.25)$$

Доказательство. \square Разложим в ряд Лорана функцию f :

$$f(z) = c_0 + \frac{c_{-1}}{z} + \frac{c_{-2}}{z^2} + \dots \quad (24.26)$$

Здесь $c_0 = f(\infty)$, сделаем замену $\zeta = \frac{1}{z}$. Тогда

$$c_0 = \lim_{\zeta \rightarrow 0} f\left(\frac{1}{\zeta}\right) \quad (24.27)$$

Получим степенной ряд с регулярной суммой по ζ . ■

B.11.5. Теорема Коши о вычетах

 *Теорема(Коши о вычетах).* Пусть $G \subset \overline{\mathbb{C}}$ – область с кусочно-гладкой положительно ориентированной границей Γ , $\overline{G} = G \cup \Gamma$. Функция f регулярна всюду в G за исключением конечного числа изолированных особых точек a_1, \dots, a_n (если лежит ∞ , мы её включаем) и f непрерывна на $\overline{G} \setminus \{a_1, \dots, a_n\}$. Тогда

$$\int_{\Gamma} f(z) dz = 2\pi i \sum_{k=1}^n \operatorname{Res}_{a_k} f. \quad (24.28)$$

Доказательство. \square

1. Пусть $\exists \rho > 0$: замыкания $\overline{B}_\rho(a_k)$ попарно не пересекаются и лежат в области G .

Пусть $\gamma_k = \{z : |z - a_k| = \rho\}$ ориентированы против часовой стрелки. Рассмотрим область

$$\tilde{G} = G \setminus \bigcup_{k=1}^n \overline{B}_\rho(a_k) \quad (24.29)$$

$$\partial \tilde{G} = \Gamma \cup \left(\bigcup_{k=1}^n \gamma_k^- \right) \quad (24.30)$$

по обобщённой интегральной теореме Коши:

$$\int_{\partial \tilde{G}} f(z) dz = 0. \quad (24.31)$$

Разобъём на сумму интегралов:

$$\int_{\Gamma} f(z) dz + \sum_{k=1}^n \int_{\gamma_k^-} f(z) dz = 0. \quad (24.32)$$

Но

$$\int_{\gamma_k^-} f(z) dz = - \int_{\gamma_k} f(z) dz = -2\pi i \cdot \underbrace{\operatorname{Res}_{a_k} f}_{\infty} \quad (24.33)$$

2. Если G – неограничена. Пусть f регулярна в $\mathring{B}_{R_0}(\infty)$. Тогда $\Gamma \subset B_R(\infty)$. Рассмотрим пересечение

$$G_R = G \cap B_R(0), \quad (24.34)$$

оно ограничено, и его граница состоит из Γ и γ_R . $\partial G_R = \Gamma \cup \gamma_R$. По теореме Коши о вычетах для конечной области

$$\int_{\Gamma} f(z) dz + \int_{\gamma_R} f(z) dz = 2\pi i \cdot \sum_{k=1}^n \operatorname{Res}_{a_k} f \quad (24.35)$$

$\overbrace{ - 2\pi i \operatorname{Res}_{\infty} f}$

Что и требовалось доказать. ■

C. Комбинаторика

В этом разделе рассматриваются основные понятия и тождества комбинаторики, а так же основы теории множеств и теории графов.

C.1. Основные правила комбинаторики

C.1.1. Правила суммы и произведения

Правило суммы Если элемент множества A можно выбрать m способами, а элемент множества B n способами, то выбор «либо A , либо B » может быть сделан $m + n$ способами, при условии, что множества A и B не пересекаются.

Доказательство: \square Пусть $A = \{a_1, \dots, a_m\}$ и $B = \{b_1, \dots, b_n\}$ Тогда

$$A \cup B = \{a_1, \dots, a_m, b_1, \dots, b_n\} \quad (25.1)$$

Здесь существенно использовано то, что $A \cap B = \emptyset$, так как тогда $\forall a \in A, \forall b \in B : a \neq b$. Следовательно, $|A \cup B| = m + n$. ■

Правило произведения. Если элемент множества A можно выбрать m способами и вслед за ним элемент множества B можно выбрать n способами, то количество способов выбрать упорядоченную пару элементов ($a \in A, b \in B$) равно $m \cdot n$.

Обобщённые правила суммы и произведения:

1. Обобщённое правило суммы. Пусть даны попарно непересекающиеся множества A_1, A_2, \dots, A_n . Число способов сделать выбор элемента из A_1 или $A_2 \dots$ или A_n равно $\sum_{i=1}^n |A_i|$. Доказывается по индукции.
2. Обобщённое правило произведения. Пусть даны множества A_1, A_2, \dots, A_n . Число способов выбрать упорядоченный кортеж $(a_1, \dots, a_n) \mid a_i \in A_i$ из n элементов равно $\prod_{i=1}^n |A_i|$. Доказывается по индукции.

C.1.2. Принцип Дирихле

Обозначим $\lceil x \rceil = \min\{a \mid a \geq x, a \in \mathbb{Z}\}$

Принцип Дирихле. Если n объектов разместить в m ящиках и $n > m$, то существует хотя бы один ящик, в котором находится не менее $\lceil \frac{n}{m} \rceil$ объектов.

Доказательство. \square Обозначим $k = \lceil \frac{n}{m} \rceil$ и предположим противное: во всех ящиках лежит меньше k объектов. Тогда для любого ящика, в нем находится не более $k - 1$ объектов. Общее число объектов тогда не превосходит $m \cdot (k - 1)$, т. е. имеет место

неравенство $n \leq m \cdot (k - 1)$. Но по свойству округления вверх: $k - 1 = \lceil \frac{n}{m} \rceil - 1 < \frac{n}{m}$.

Имеем:

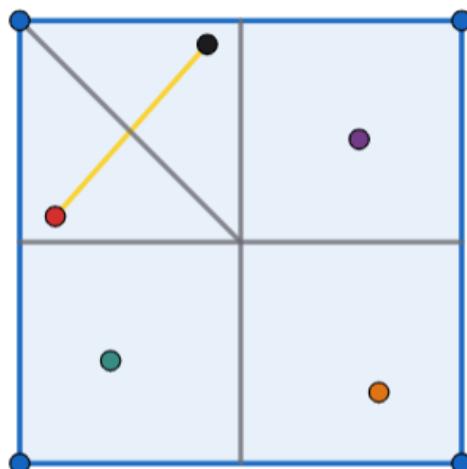
$$\begin{cases} n \leq m \cdot (k - 1) \\ n > m \cdot (k - 1) \end{cases} \quad (25.2)$$

Получили противоречие, значит противное неверно и исходное утверждение доказано. ■

C.1.3. Примеры

1. В квадрате со стороной два случайным образом выбрали 5 точек. Доказать, что расстояние между любыми двумя из них не больше $\sqrt{2}$.

Решение. □ Разобьём квадрат на 4 одинаковых единичных квадрата. По принципу Дирихле, найдётся единичный квадрат, в котором не меньше двух точек.



Внутри единичного квадрата точки расположены на расстоянии не большем, чем диагональ, равная $\sqrt{2}$. ■

C.2. Множества

«Элемент a принадлежит множеству A » обозначают $a \in A$. Отрицание этого утверждения обозначается $a \notin A$.

Множество B называется подмножеством A , если $\forall x \in B : x \in A$. Обозначают $B \subset A$.

Множества A и B называются равными, если $A \subset B \wedge B \subset A$. Обозначают $A = B$.

Пустым множеством называется множество, не содержащее ни одного элемента. Оно является подмножеством любого множества. Обозначается \emptyset . $\forall A : \emptyset \subset A$

C.2.1. Операции на множествах

Основные бинарные операции над множествами определены так:

1. Объединение. $A \cup B = \{x \mid x \in A \vee x \in B\}$
2. Пересечение. $A \cap B = \{x \mid x \in A \wedge x \in B\}$
3. Разность. $A \setminus B = \{x \mid x \in A \wedge x \notin B\}$
4. Симметрическая разность. $A \Delta B = (A \setminus B) \cup (B \setminus A)$

C.2.2. Свойства бинарных операций над множествами

1. Коммутативность объединения и пересечения:

- $A \cup B = B \cup A$
- $A \cap B = B \cap A$.

2. Ассоциативность объединения и пересечения:

- $(A \cup B) \cup C = A \cup (B \cup C)$
- $(A \cap B) \cap C = A \cap (B \cap C)$.

3. Дистрибутивность объединения и пересечения:

- $A \cap (B \cup C) = (A \cap B) \cup (A \cap C)$
- $A \cup (B \cap C) = (A \cup B) \cap (A \cup C)$.

C.2.3. Кортеж

Кортежем называется упорядоченная п-ка элементов. Обозначается как

$$(a_1, a_2, \dots, a_n) \text{ или } \langle a_1, a_2, \dots, a_n \rangle \quad (26.1)$$

Более строго, можно индуктивно сопоставить кортежи множествам:

- $\emptyset \leftrightarrow \langle \rangle$
- $\{a_1\} \leftrightarrow \langle a_1 \rangle$
- $\{a_1, \{a_1, a_2\}\} \leftrightarrow \langle a_1, a_2 \rangle$

Тогда:

$$\bullet \{a_1, a_2, \dots, a_n\} \leftrightarrow \langle a_1, a_2, \dots, a_n \rangle \stackrel{\text{def}}{=} \langle \langle a_1, a_2, \dots, a_{n-1} \rangle, a_n \rangle$$

Альтернативно, можно дать такое определение:

$$\langle a_1, a_2, \dots, a_n \rangle = f : [n] \rightarrow \{a_1, a_2, \dots, a_n\} \quad (26.2)$$

C.2.4. Декартово произведение

Декартовым произведением двух множеств A и B называется множество всех упорядоченных пар элементов из A и B .

$$A \times B = \{(a, b) \mid a \in A, b \in B\} \quad (26.3)$$

Свойства декартова произведения:

1. Некоммутативность. Вообще говоря, $A \times B \neq B \times A$, если $A \neq B$
2. Ассоциативность. $A \times (B \times C) = (A \times B) \times C$
3. Дистрибутивность относительно объединения и пересечения(по левому и по правому множителю):

- $A \times (B \cup C) = A \times B \cup A \times C$
- $A \times (B \cap C) = A \times B \cap A \times C$
- $(B \cup C) \times A = B \times A \cup C \times A$
- $(B \cap C) \times A = B \times A \cap C \times A$

C.2.5. Возвведение множества в степень множества

Определение. Для множеств $A, B : A^B$ – множество всех отображений $B \rightarrow A$

Определение. Булевом множества A называется множество всех подмножеств A и обозначается 2^A .

Каждое подмножество $S \subseteq A \leftrightarrow \chi_S : A \rightarrow \{0, 1\}$

$$\chi_S(x) = \begin{cases} 1, & x \in S \\ 0, & x \notin S \end{cases} \quad (26.4)$$

C.2.6. Частичный порядок

Определение. Бинарное отношение называется частичным порядком, если

1. Рефлексивность:

$$x \leq x \quad (26.5)$$

2. Антисимметричность:

$$(x \leq y \wedge y \leq x) \rightarrow x = y \quad (26.6)$$

3. Транзитивность:

$$(x \leq y \wedge y \leq z) \rightarrow x \leq z \quad (26.7)$$

Определение. Линейным порядком называется условие

$$\forall x, y : (x \leq y \vee y \leq x) \quad (26.8)$$

Определение. Строгим порядком называется условие

$$x < y := (x \leq y \wedge x \neq y) \quad (26.9)$$

Определение. Обратный порядок.

$$x \geq y := (y \leq x) \quad (26.10)$$

C.3. Перестановки, сочетания и размещения

Существуют две градации выбора из множества A .

1. Выбор с учётом порядка и без учёта порядка.
2. Выбор с возвращением и без возвращения.

Определение. Размещением называется выбор с учётом порядка. Обозначается A_n^k для выбора без возвращения и \overline{A}_n^k для выбора с возвращением.

Определение. Сочетанием называется выбор без учёта порядка. Обозначается C_n^k для выбора без возвращения и \overline{C}_n^k для выбора с возвращением.

Предложение. Число размещений с повторениями равно

$$\overline{A}_n^k = n^k \quad (27.1)$$

□ По правилу произведения мы выбираем с возвращением по n элементов k раз. ■

Предложение. Число размещений без повторений равно

$$A_n^k = n \cdot (n - 1) \cdot \dots \cdot (n - k + 1) = \frac{n!}{(n - k)!} \quad (27.2)$$

Предложение. Число сочетаний без повторений равно

$$C_n^k = \frac{A_n^k}{k!} = \frac{n!}{(n - k)!k!} \quad (27.3)$$

Определение. Перестановкой из k называется размещение A_k^k .

Предложение. Число перестановок из k равно

$$P_k = A_k^k = k! \quad (27.4)$$

Теорема. Число сочетаний с повторениями равно

$$\overline{C}_n^k = C_{n+k-1}^k = \frac{(n + k - 1)!}{k!(n - 1)!} \quad (27.5)$$

Доказательство. □ Каждой выборке длины k можно взаимно однозначно сопоставить последовательность 0 и 1 длины $n + k - 1$, где для входящих в неё элементов исходного множества будет количество единиц, равное количеству вхождений, а между буквами стоять перегородки в виде нулей. Последовательностей к k единицами ровно C_{n+k-1}^k . ■

C.3.1. Тождества с биномиальными коэффициентами

1. Симметричность:

$$C_n^k = C_n^{n-k} \quad (27.6)$$

Доказательство. \square Между сочетаниями из n по k и из n по $n - k$ существует взаимно однозначное соответствие: каждому сочетанию из k элементов соответствует дополнение до n элементов, состоящее из $n - k$ элементов, поэтому $C_n^k = C_n^{n-k}$. ■

2. Бином Ньютона. $\forall x, y \in \mathbb{R}, \forall n \in \mathbb{N}$:

$$(x + y)^n = \sum_{k=0}^n C_n^k x^k y^{n-k} \quad (27.7)$$

Доказательство. \square Всего в произведении n скобок, и из каждой можно выбрать либо x , либо y .

$$\underbrace{(x + y) \cdot \dots \cdot (x + y)}_{n \text{ скобок}} \quad (27.8)$$

Если мы k раз выбрали x , то y будет $(n - k)$ раз, а всего степень $x^k y^{n-k}$ встретится ровно столько раз, сколькими способами можно выбрать из n скобок k , то есть C_n^k , и это верно $\forall k = 0, \dots, n$. ■

3. Сумма двух чисел в треугольнике Паскаля:

$$C_n^k = C_{n-1}^k + C_{n-1}^{k-1} \quad (27.9)$$

Доказательство. \square Рассмотрим множество всех k -сочетаний из $\{a_1, \dots, a_n\}$. Их всего C_n^k . Но с другой стороны, это множество можно разбить на два непересекающихся подмножества: первое содержит a_1 , а второе не содержит. Мощность первого равна C_{n-1}^k , а второго C_{n-1}^{k-1} , поэтому $C_n^k = C_{n-1}^k + C_{n-1}^{k-1}$. ■

В силу этого свойства биномиальные коэффициенты можно быстро выписать в треугольник Паскаля:

$$\begin{array}{ccccccc} & & & & 1 & & \\ & & & & 1 & 1 & \\ & & & & 1 & 2 & 1 \\ & & & & 1 & 3 & 3 & 1 \\ & & & & 1 & 4 & 6 & 4 & 1 \\ & & & & \dots & & & \end{array} \quad (27.10)$$

4. Сумма чисел в одной строке треугольника Паскаля

$$C_n^0 + C_n^1 + \dots + C_n^n = 2^n \quad (27.11)$$

Доказательство 1. \square Подставим в ((27.7)) $x = y = 1$, и получим

$$(1+1)^n = C_n^0 \cdot 1 \cdot 1 + \dots + C_n^n \cdot 1 \cdot 1 \quad (27.12)$$

Что и требовалось доказать. ■

Доказательство 2. \square Количество строк из 0 и 1 длины n равно 2^n , для всех $k = 0, \dots, n$ последовательностей с k единиц будет C_n^k , поэтому суммируя по всем k , получим, что сумма биномиальных коэффициентов равна 2^n . ■

5. Сумма квадратов биномиальных коэффициентов.

$$(C_n^0)^2 + (C_n^1)^2 + \dots + (C_n^n)^2 = C_{2n}^n \quad (27.13)$$

Доказательство. \square Рассмотрим множество $\{a_1, \dots, a_n, a_{n+1}, \dots, a_{2n}\}$. Здесь C_{2n}^n n -сочетаний. Пусть k – количество объектов из n -сочетания, попавших в первые n . Значит в другой половине множества $(n - k)$ объектов. Всего способов выбрать k из левой половины и $(n - k)$ из правой: $C_n^k \cdot C_n^{n-k} = (C_n^k)^2$. Значит всего n -сочетаний есть

$$\sum_{k=0}^n (C_n^k)^2 = C_{2n}^n \quad (27.14)$$

■

6. Знакопеременная сумма биномиальных коэффициентов. Если $n \neq 0$, то

$$C_n^0 - C_n^1 + \dots + (-1)^n C_n^n = 0 \quad (27.15)$$

C.3.2. Перестановки с повторениями

Определение. Последовательность из n_1 объектов типа a_1, \dots, n_k объектов типа a_k , где все объекты задействованы, называется перестановкой с повторениями.

Предложение. Если есть n_1 объектов типа a_1, \dots, n_k объектов типа a_k , то количество перестановок с повторениями равно

$$P(n_1, \dots, n_k) = \frac{(n_1 + \dots + n_k)!}{n_1! \cdot n_2! \cdot \dots \cdot n_k!} \quad (27.16)$$

Доказательство. \square Согласно правилу произведения, обозначив $n = n_1 + \dots + n_k$, имеем

$$P(n_1, \dots, n_k) = C_n^{n_1} \cdot C_{n-n_1}^{n_2} \cdot \dots \cdot C_{n_k}^{n_k} \quad (27.17)$$

■

C.3.3. Полиномиальная формула

Найдём по аналогии с биномом Ньютона разложение для $(x_1 + \dots + x_k)^n$.

$$(x_1 + \dots + x_k)^n = \underbrace{(x_1 + \dots + x_k) \cdot \dots \cdot (x_1 + \dots + x_k)}_n \quad (27.18)$$

Пусть n_1 — число скобок, из которых берётся x_1 , n_2 — число скобок, из которых берётся x_2 , ..., n_k — число скобок, из которых берём x_k . Про эти числа можно сказать, что

$$\begin{cases} n_1 + \dots + n_k = n \\ n_i \geq 0 \ \forall i = 1, \dots, k \end{cases} \quad (27.19)$$

После раскрытия скобок и приведения подобных слагаемых получим, что при каких-то n_1, n_2, \dots, n_k будет такой полиномиальный коэффициент:

$$P(n_1, \dots, n_k) \cdot x^{n_1} \cdot x^{n_2} \cdot \dots \cdot x^{n_k} \quad (27.20)$$

Итак, полиномиальная формула получается суммой по всем таким слагаемым

$$(x_1 + \dots + x_k)^n = \sum_{\substack{(n_1, \dots, n_k): \\ n_1 + \dots + n_k = n \\ \forall i \ n_i \geq 0}} P(n_1, \dots, n_k) \cdot x_1^{n_1} \cdot \dots \cdot x_k^{n_k} \quad (27.21)$$

Следствие. Сумма полиномиальных коэффициентов равна

$$\sum_{\substack{(n_1, \dots, n_k): \\ n_1 + \dots + n_k = n \\ \forall i \ n_i \geq 0}} P(n_1, \dots, n_k) = k^n \quad (27.22)$$

C.3.4. Ещё одно тождество с биномиальными коэффициентами

Предложение.

$$C_{n+m-1}^{n-1} + C_{n+m-2}^{n-1} + \dots + C_{n-1}^{n-1} = C_{n+m}^n \quad (27.23)$$

Доказательство. □ Рассмотрим множество $\{a_1, \dots, a_n, a_{n+1}\}$ и все m сочетания с повторениями из него. С одной стороны, их

$$\overline{C_{n+1}^m} = C_{n+m}^m = C_{n+m}^n \quad (27.24)$$

С другой стороны, пусть $k = 0, \dots, m$. Посчитаем все m -сочетания с повторениями, в которых ровно k раз встречается a_1 . Их всего

$$\overline{C_n^{m-k}} = C_{n+m-k-1}^{m-k} = C_{n+m-k-1}^{n-1} \quad (27.25)$$

Суммируя по всем k , получим равенство из предложения. ■

Следствие 1. Сумма многих арифметических прогрессий. Подставляя $n = 3$, имеем

$$\frac{(m+2)(m+1)}{2} + \frac{(m+1)m}{2} + \dots + \frac{2 \cdot 1}{2} = \frac{(m+3)(m+2)(m+1)}{6} \quad (27.26)$$

Следствие 1.1. Из ((27.26)) можно получить формулу суммы квадратов первых n натуральных чисел.

□

$$\frac{(m+1)^2}{2} + \frac{m+1}{2} + \frac{m^2}{2} + \frac{m}{2} + \dots + \frac{1^2}{2} + \frac{1}{2} = \frac{(m+3)(m+2)(m+1)}{6} \quad (27.27)$$

Откуда

$$\frac{1}{2} \cdot (1^2 + \dots + (m+1)^2) + \frac{1}{2} \cdot (1 + \dots + (m+1)) = \frac{(m+3)(m+2)(m+1)}{6} \quad (27.28)$$

Выразим сумму квадратов

$$(1^2 + \dots + (m+1)^2) = 2 \cdot \frac{(m+3)(m+2)(m+1)}{6} - 2 \cdot \frac{(m+2)(m+1)}{4} \quad (27.29)$$

итак

$$1^2 + \dots + (m+1)^2 = \frac{(m+1)(m+2)(2m+3)}{6} \quad (27.30)$$

Теперь можно заменить $m+1 = n$. ■

Аналогично, можно последовательно получать формулы суммы 3, 4, 5... степеней первых n натуральных чисел.

C.4. Формула включений-исключений

 **Теорема.** Пусть даны объекты $\{a_1, \dots, a_N\}$ и свойства $\{\alpha_1, \dots, \alpha_n\}$. Обозначим $N(\alpha_i)$ количество объектов, обладающих свойством α_i . За $N(\alpha_i, \alpha_j)$ — количество объектов, обладающих свойствами α_i, α_j и так далее. За α'_i обозначим отрицание свойства α_i . Утверждается, что

$$N(\alpha'_1, \dots, \alpha'_n) = N(\alpha_1) + \dots + N(\alpha_n) - N(\alpha_1, \alpha_2) - \dots - N(\alpha_{n-1}, \alpha_n) + \\ + \dots + (-1)^n N(\alpha_1, \dots, \alpha_n)$$

(слагаемых для набора из k свойств ровно C_n^k).

Доказательство. \square Докажем индукцией по n .

1. База. При $n = 1$: $N(\alpha') = N - N(\alpha)$ — тривиально.
2. Предположение индукции. Пусть $\forall k \leq n, n \geq 1$ доказано, что

$$N(\alpha'_1, \dots, \alpha'_k) = N(\alpha_1) + \dots + N(\alpha_k) - N(\alpha_1, \alpha_2) - \dots - N(\alpha_{k-1}, \alpha_k) + \\ + \dots + (-1)^k N(\alpha_1, \dots, \alpha_k) \quad (28.1)$$

3. Шаг индукции. Пусть $k = n + 1$. Для объектов $\{a_1, \dots, a_N\}$ и свойств $\alpha_1, \dots, \alpha_n, \alpha_{n+1}$ докажем утверждение. Применим к $a_1, \dots, a_N, \alpha_1, \dots, \alpha_n$ предположение индукции.

Рассмотрим среди a_1, \dots, a_N те и только те объекты, которые обладают свойством α_{n+1} : их $N(\alpha_{n+1}) = M$. Тогда $\{b_1, \dots, b_M\} \subseteq \{a_1, \dots, a_N\}$. Применим предположение индукции к $b_1, \dots, b_M, \alpha_1, \dots, \alpha_n$

$$M(\alpha'_1, \dots, \alpha'_n) = M - M(\alpha_1) - \dots - M(\alpha_n) + \dots + \\ + (-1)^n M(\alpha_1, \dots, \alpha_n) \quad (28.2)$$

Но

$$M(\alpha'_1, \dots, \alpha'_n) = N(\alpha'_1, \dots, \alpha'_n, \alpha_{n+1}) \quad (28.3)$$

Поэтому вычитая одно из другого получим

$$N(\alpha'_1, \dots, \alpha'_n) - N(\alpha'_1, \dots, \alpha'_n, \alpha_{n+1}) = N - N(\alpha_1) - \dots - N(\alpha_n) - \\ - N(\alpha_{n+1}) + N(\alpha_1, \alpha_2) + \dots + N(\alpha_n, \alpha_{n+1}) - \dots + (-1)^{n+1} N(\alpha_1, \dots, \alpha_n, \alpha_{n+1}) \quad (28.4)$$

$$\text{Но } N(\alpha'_1, \dots, \alpha'_n) - N(\alpha'_1, \dots, \alpha'_n, \alpha_{n+1}) = N(\alpha'_1, \dots, \alpha'_{n+1}). \blacksquare$$

C.4.1. Применение ФВИ

Рассмотрим множество $A = \{a_1, \dots, a_n\}$ и число $m < n$. Рассмотрим все возможные m -размещения с повторениями: их $N = n^m$. Обозначим α_i свойство « a_i не входит в размещение». Тогда $N(\alpha_i) = (n-1)^m$, $N(\alpha_i, \alpha_j) = (n-2)^m$, ... $N(\alpha_1, \dots, \alpha_n) = (n-n)^m$. Кроме того,

$$N(\alpha'_1, \dots, \alpha'_n) = 0 \quad (28.5)$$

так как такое m -размещение должно содержать все n объектов, но $m < n$. По ФВИ имеем:

$$\sum_{k=0}^n (-1)^k C_n^k (n-k)^m = 0 \quad (28.6)$$

C.4.2. Вероятность беспорядка

Рассмотрим такие перестановки n -элементного множества, где каждый элемент оказывается не на своём месте. Какова вероятность случайно получить такую перестановку(беспорядок)?

Решение. \square Всего $N = n!$ перестановок. Обозначим α_i — элемент i на своём месте. Ясно, что $N(\alpha_i) = (n-1)!$. Тогда Число беспорядков равно по ФВИ

$$N(\alpha'_1, \dots, \alpha'_n) = n! - n \cdot (n-1)! + C_n^2 \cdot (n-2)! - \dots + (-1)^n C_n^n \cdot 0! \quad (28.7)$$

Поэтому искомая вероятность равна

$$p_n = \frac{N(\alpha'_1, \dots, \alpha'_n)}{n!} = \frac{1}{0!} - \frac{1}{1!} + \frac{1}{2!} - \dots + (-1)^n \frac{1}{n!} \approx e^{-1} \quad (28.8)$$

При $n \rightarrow \infty$ $p_n \rightarrow \frac{1}{e} \approx 0,36787$. ■

C.5. Функция Мёбиуса

Определение. Функцией Мёбиуса называется функция $\mu : \mathbb{N} \rightarrow \{-1, 0, 1\}$, по определению равная

$$\mu(n) = \begin{cases} 1, & \text{если } n = 1 \\ (-1)^s, & \text{если } n = p_1 \cdot \dots \cdot p_s \\ 0, & \text{иначе} \end{cases} \quad (29.1)$$

где p_1, \dots, p_s — различные простые числа.

Лемма. Сумма значений функции Мёбиуса по делителям числа равна

$$\sum_{d|n} \mu(d) = \begin{cases} 1, & \text{если } n = 1 \\ 0, & \text{иначе} \end{cases} \quad (29.2)$$

Доказательство. \square Если $n = 1$, то утверждение тривиально. Пусть $n \geq 2$. Тогда согласно основной теореме арифметики, можно написать каноническое разложение

$$n = p_1^{\alpha_1} \cdot \dots \cdot p_s^{\alpha_s} \quad (29.3)$$

Отсюда следует, что

$$d | n \Leftrightarrow d = p_1^{\beta_1} \cdot \dots \cdot p_s^{\beta_s}, \quad (29.4)$$

где $0 \leq \beta_i \leq \alpha_i$ для всех $i = 1, \dots, s$. ■

Тогда

$$\sum_{d|n} \mu(d) = \sum_{\beta_1=0}^{\alpha_1} \dots \sum_{\beta_s=0}^{\alpha_s} \mu(p_1^{\beta_1} \cdot \dots \cdot p_s^{\beta_s}) \quad (29.5)$$

этую сумму можно переписать так

$$\sum_{\beta_1=0}^1 \dots \sum_{\beta_s=0}^1 \mu(p_1^{\beta_1} \cdot \dots \cdot p_s^{\beta_s}) = C_s^0 + (-1) \cdot C_s^1 + C_s^2 + \dots + (-1)^s C_s^s = 0. \quad (29.6)$$

C.5.1. Формула обращения Мёбиуса

 Пусть $f(n)$ — функция натурального аргумента. Пусть $g(n) = \sum_{d|n} f(d)$. Тогда можно выразить f через g :

$$f(n) = \sum_{d|n} \mu(d) \cdot g\left(\frac{n}{d}\right) = \sum_{d|n} \mu\left(\frac{n}{d}\right) \cdot g(d) \quad (29.7)$$

Доказательство. \square Запишем сумму значений g

$$\begin{aligned}
\sum_{d \mid n} \mu(n) g\left(\frac{n}{d}\right) &= \sum_{d \mid n} \mu(d) \cdot \left(\sum_{d' \mid \frac{n}{d}} f(d') \right) = \sum_{(d, d'): d \cdot d' \mid n} \mu(d) \cdot f(d') = \\
&= \sum_{d \mid n} f(d) \cdot \left(\sum_{d' \mid \frac{n}{d}} \mu(d') \right) = f(n) \cdot 1 + \underbrace{\sum_{\substack{d \mid n \\ d < n}} f(d) \cdot \left(\sum_{d' \mid \frac{n}{d}} \mu(d') \right)}_{0 \text{ по лемме}} = \\
&= f(n)
\end{aligned} \tag{29.8}$$

Что и требовалось доказать. ■

C.5.2. Решение комбинаторной задачи

Пусть дан алфавит $X = \{b_1, \dots, b_r\}$, n — длина слова. Надо найти $T_r(n)$ — количество всех возможных циклических слов длины n над алфавитом мощности r .

□ Пусть a_1, \dots, a_n — нециклическое слово, а (a_1, \dots, a_n) — циклическое слово, то есть класс эквивалентности обычных слов.

Если сделать n циклических сдвигов, то слово перейдёт в себя.

Определение. Назовём периодом линейного слова минимальное натуральное число d такое, что после d циклических сдвигов получается исходное слово. То есть $\sigma^d(a_1, \dots, a_n) = (a_1, \dots, a_n)$, где $\sigma \in S_n$ и при этом является циклом.

Лемма 1. У линейной последовательности длины n период d является делителем n .

Доказательство. □ Предположим, что $d \nmid n$. Тогда $n = d \cdot k + r$, где $1 \leq r \leq d - 1$. Применим $k \cdot d$ циклический сдвиг, и получим исходное слово a_1, \dots, a_n . Далее применим ещё r сдвигов, и получается, что всего было сделано n сдвигов и должно получиться a_1, \dots, a_n . Но d — минимальное число сдвигов, а $r < d$ — противоречие. ■

Лемма 2. Если длина линейного слова n и период d , то слово имеет вид:

$$\underbrace{\overbrace{a_1, \dots, a_d}^{\text{блок периода } d}, a_1, \dots, a_d, \dots, a_1, \dots, a_d}_{\frac{n}{d} \text{ блоков}} \tag{29.9}$$

Обозначим V множество всех линейных последовательностей длины n над алфавитом X . Тогда $|V| = r^n$. Рассмотрим делители числа n : $1 = d_s < d_2 < \dots < d_s = n$.

Пусть $V \supset V_i$ — множество всех линейных слов периода d_i . Тогда

$$V = \bigsqcup_{i=1}^s V_i \Rightarrow r^n = |V_1| + \dots + |V_s| \tag{29.10}$$

Пусть W_i — множество всех линейных последовательностей длины d_i и периода d_i .

Тогда $|W_i| = |V_i|$.

$$r^n = |W_1| + \dots + |W_s| \quad (29.11)$$

Пусть U_i — множество всех циклических слов, которые можно получить из слов W_i .

Тогда $d_i \cdot |U_i| = |W_i|$.

Если обозначить $M(d_i) := |U_i|$, то

$$r^n = \sum_{d \mid n} d \cdot M(d) \quad (29.12)$$

Чтобы воспользоваться формулой обращения Мёбиуса, можно сказать, что $g(n) = r^n$ и $f(n) = n \cdot M(n)$. Тогда

$$n \cdot M(n) = \sum_{d \mid n} \mu(d) \cdot r^{\frac{n}{d}} \quad (29.13)$$

Итак, мы получили $M(n)$ — количество циклических слов, которые получаются из линейных слов длины n и периода n :

$$M(n) = \frac{1}{n} \sum_{d \mid n} \mu(d) \cdot r^{\frac{n}{d}} \quad (29.14)$$

Теперь для любого циклического слова, в силу его разбиения на d -блоки, мы находим искомое значение $T_r(n)$:

$$T_r(n) = \sum_{d \mid n} M(d) = \sum_{d \mid n} \frac{1}{d} \cdot \left(\sum_{d' \mid d} \mu(d') \cdot r^{\frac{d}{d'}} \right) \quad (29.15)$$

C.5.3. Функция Мёбиуса на ЧУМе

Определение. Пусть (P, \preccurlyeq) — частично упорядоченное множество, в котором верно, что $\forall x \in P \exists$ лишь конечное число $y : y \preccurlyeq x$. Тогда для $x, y \in P : x \preccurlyeq y$ функция Мёбиуса $\mu(x, y)$ определяется следующим образом:

$$\begin{aligned} \mu(x, x) &= 1, \\ \mu(x, y) &= - \sum_{x \preccurlyeq z \preccurlyeq y} \mu(x, z), \text{ если } x \prec y \end{aligned} \quad (29.16)$$

 **Теорема.** Если $(P, \preccurlyeq) = (\mathbb{N}, |)$, то

$$\mu(x, y) = \mu\left(\frac{y}{x}\right) \quad (29.17)$$

Доказательство. \square Индукция по величине $\frac{x}{y}$.

1. База $\mu(x, x) = \mu\left(\frac{x}{x}\right) = 1$.
2. Предположим, что это верно и сделаем шаг индукции. Пусть отношение имеет каноническое разложение

$$y = x \cdot p_1^{\alpha_1} \cdot \dots \cdot p_s^{\alpha_s} \quad (29.18)$$

Запишем обобщённую функцию Мёбиуса

$$\mu(x, y) = - \sum_{x \preccurlyeq z \prec y} \mu(x, z) \quad (29.19)$$

Распишем $z = x \cdot p_1^{\beta_1} \cdot \dots \cdot p_s^{\beta_s}$, где $\forall i \ 0 \leq \beta_i \leq \alpha_i$, причём $\exists i : \beta_i < \alpha_i$, так как $z \prec y$ строго! Тогда

$$\mu(x, y) = - \sum_{x \preccurlyeq z \prec y} \mu\left(\frac{z}{x}\right) = - \sum_{\substack{(\beta_1, \dots, \beta_s): \\ \forall i: 0 \leq \beta_i \leq \alpha_i, \\ \exists i: \beta_i < \alpha_i}} \mu\left(p_1^{\beta_1} \cdot \dots \cdot p_s^{\beta_s}\right) \quad (29.20)$$

2.1. Если все $\alpha_i = 1$, то

$$\begin{aligned} \mu(x, y) &= - \sum_{\substack{(\beta_1, \dots, \beta_s): \\ \forall i: 0 \leq \beta_i \leq 1, \\ \exists i: \beta_i < 1}} \mu\left(p_1^{\beta_1} \cdot \dots \cdot p_s^{\beta_s}\right) = -(C_s^0 - C_s^1 + \dots \\ &\dots + (-1)^{s-1} C_s^{s-1}) = -(-(-1)^s C_s^s) = (-1)^s = \mu\left(\frac{y}{x}\right). \end{aligned} \quad (29.21)$$

2.2. Если $\exists i : \alpha_i \geq 2$, то в суммировании в выкладке ((29.21)) появляется $(-1)^s C_s^s$, из-за чего сумма равна нулю, что и есть $\mu\left(\frac{y}{x}\right)$.

■

C.5.4. Обращение Мёбиуса на ЧУМе

 **Теорема.** Пусть на (P, \preccurlyeq) верно $g(y) = \sum_{x \preccurlyeq y} f(x)$. Тогда

$$f(y) = \sum_{x \preccurlyeq y} g(x) \cdot \mu(x, y) \quad (29.22)$$

Доказательство. \square

$$\sum_{x \preccurlyeq y} \mu(x, y) \cdot \left(\sum_{z \preccurlyeq x} f(z) \right) = \sum_{z \preccurlyeq y} f(z) \cdot \left(\sum_{z \preccurlyeq x \preccurlyeq y} \mu(x, y) \right) \text{ лемма } \sum_{z \preccurlyeq y} f(z) \cdot \mathbf{1}_{\{y=z\}} \quad (29.23)$$

где $\mathbf{1}_{\{y=z\}}$ — индикатор.

Тогда

$$\sum_{x \preccurlyeq y} g(x) \cdot \mu(x, y) = f(y) \cdot 1 + \sum_{z \prec y} f(z) \cdot \mathbf{1}_{\{y=z\}} = f(y). \quad (29.24)$$

■

Теперь докажем лемму, использованную в доказательстве теоремы.

 **Лемма.** Сумма значений функции Мёбиуса равна индикатору:

$$\sum_{z \preccurlyeq x \preccurlyeq y} \mu(x, y) = \mathbf{1}_{\{y=z\}} \quad (29.25)$$

Доказательство. \square Если $z = y$, то

$$\sum_{z \preccurlyeq x \preccurlyeq y} \mu(x, y) = \mu(y, y) = 1 = \mathbf{1}_{\{y=z\}}. \quad (29.26)$$

Если $z \prec y$, то рассмотрим два случая:

1. Между z и y нет других элементов. Тогда

$$\begin{aligned} \sum_{z \preccurlyeq x \preccurlyeq y} \mu(x, y) &= \mu(y, y) + \sum_{z \preccurlyeq x \prec y} \mu(x, y) = 1 + \mu(z, y) = \\ &= 1 - \sum_{z \preccurlyeq u \prec y} \mu(z, u) = 1 - \mu(z, z) = 0. \end{aligned} \quad (29.27)$$

2. Индукция по длине длиннейшей цепочки значков \prec между z и y .

$$\begin{aligned} \sum_{z \preccurlyeq x \preccurlyeq y} \mu(x, y) &= 1 + \sum_{z \preccurlyeq x \prec y} \mu(x, y) = 1 - \sum_{z \preccurlyeq x \preccurlyeq y} \sum_{x \preccurlyeq u \preccurlyeq y} \mu(x, u) = \\ &= 1 - \sum_{z \preccurlyeq u \preccurlyeq y} \sum_{\substack{z \preccurlyeq x \preccurlyeq u \\ \mathbf{1}_{\{z=u\}} \text{ по предп. инд.}}} \mu(x, u) = 1 - 1 = 0. \blacksquare \end{aligned} \quad (29.28)$$

C.5.5. Пример применения обращения Мёбиуса на ЧУМе для доказательства

ФВИ

Обозначим $\mathcal{R}_n = \{1, \dots, n\}$. Рассмотрим ЧУМ $(2^{\mathcal{R}_n}, \subseteq)$.

Рассмотрим произвольные множества A_1, \dots, A_n , необязательно элементы $2^{\mathcal{R}_n}$, и пусть $A = A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_n$.

Пусть $I \subseteq \mathcal{R}_n$.

Определим $f(I)$ как количество элементов из A , которые принадлежат всем множествам A_i при $i \notin I$ и могут как принадлежать, так и не принадлежать A_i , $i \in I$.

$$f(I) = \left| \bigcap_{i \notin I} A_i \right| \quad (29.29)$$

И пусть $g(I)$ это количество элементов из A , которые принадлежат всем множествам A_i при $i \notin I$ и не принадлежат ни одному A_i при $i \in I$.

Тогда можно разбить пересечение множеств на части:

$$f(I) = \sum_{I' \subseteq I} g(I') \quad (29.30)$$

И, используя формулу обращения Мёбиуса на ЧУМе, получаем

$$g(I) = \sum_{I' \subseteq I} f(I') \cdot \mu(I', I) \quad (29.31)$$

 **Лемма.** На ЧУМе $(2^{\mathcal{R}_n}, \subseteq)$ функция Мёбиуса имеет вид

$$\mu(I', I) = (-1)^{|I| - |I'|} \quad (29.32)$$

докажем её позже.

Если $I = \mathcal{R}_n$, то $g(I) = 0$, поэтому

$$0 = \sum_{I' \subseteq \mathcal{R}_n} f(I') \cdot (-1)^{n - |I'|} \cdot \left| \bigcap_{i \notin I'} A_i \right| = f(\mathcal{R}_n) + \sum_{I' \subset \mathcal{R}_n} (-1)^{n - |I'|} \cdot \left| \bigcap_{i \notin I'} A_i \right| \quad (29.33)$$

Откуда можно найти мощность объединения, так как $f(\mathcal{R}_n) = \left| \bigcup_{i=1}^n A_i \right|$

$$\left| \bigcup_{i=1}^n A_i \right| = \sum_{I' \subset \mathcal{R}_n} (-1)^{n - |I'| + 1} \cdot \left| \bigcap_{i \notin I'} A_i \right| \quad (29.34)$$

Преобразуем через дополнение, получая ФВИ

$$\left| \bigcup_{i=1}^n A_i \right| = \sum_{\substack{J \neq \emptyset \\ J \subseteq \mathcal{R}_n}} (-1)^{|J| + 1} \cdot \left| \bigcap_{j \in J} A_j \right| \quad (29.35)$$

Доказательство леммы.  Докажем индукцией по $|I| - |I'|$.

1. База. $|I| - |I'| = 0$. Тогда $\mu(I', I) = 1 = (-1)^0$. 
2. Шаг индукции. Пусть предположение верно, и мы знаем, что $I' \subset I$. Тогда

$$\mu(I', I) = - \sum_{I' \subseteq J \subset I} \mu(I', J) \quad (29.36)$$

Так как $|J| - |I'| < |I| - |I'|$, то по предположению индукции

$$\mu(I', J) = (-1)^{|J| - |I'|} \quad (29.37)$$

Поэтому

$$\begin{aligned} \mu(I', I) &= - \sum_{I' \subseteq J \subset I} (-1)^{|J| - |I'|} = - \sum_{k=|I'|}^{|J|-1} (-1)^{k - |I'|} \cdot C_{|I| - |I'|}^{k - |I'|} = \\ &= - \sum_{l=0}^{|I| - |I'| - 1} (-1)^l \cdot C_{|I| - |I'|}^l = -(-(-1)^{|I| - |I'|}) = (-1)^{|I| - |I'|}. \blacksquare \end{aligned} \quad (29.38)$$

C.6. Разбиение чисел в суммы

Мы хотим для заданного $n \in \mathbb{N}$ подсчитать, сколькими способами можно сделать разбиение $n = x_1 + x_2 + \dots + x_t$, где $x_i \in \mathbb{N}$.

Пусть $\forall i x_i \in \{n_1, \dots, n_k\}$ Пусть $f(n; n_1, \dots, n_k)$ — количество всех упорядоченных разбиений числа n на слагаемые n_1, \dots, n_k .

 **Теорема.** Рекуррента для $f(n; n_1, \dots, n_k)$ имеет вид

$$f(n; n_1, \dots, n_k) = f(n - n_1; n_1, \dots, n_k) + \dots + f(n - n_k; n_1, \dots, n_k) \quad (30.1)$$

$$f(0; n_1, \dots, n_k) = 1, \quad f(-n; n_1, \dots, n_k) = 0 \quad (30.2)$$

 **Следствие.**

$$f(n; 1, 2, \dots, n) = 2^{n-1} \quad (30.3)$$

Если же порядок не важен, вычислим по-другому. Пусть $F(n; n_1, \dots, n_k)$

 **Теорема.** Рекуррента для $F(n; n_1, \dots, n_k)$ имеет вид

$$F(n; n_1, \dots, n_k) = F(n - n_1; n_1, \dots, n_k) + F(n; n_2, \dots, n_k), \quad (30.4)$$

$$\begin{aligned} F(0; n_{i_1}, \dots, n_{i_l}) &= 1, \quad F(-n; n_{i_1}, \dots, n_{i_l}) = 0 \\ F(m; \emptyset) &= 0 \end{aligned} \quad (30.5)$$

Обозначим $p(n) = F(n; 1, \dots, n)$

 **Теорема (Харди-Рамануджана).** Асимптотика $p(n)$ имеет вид:

$$p(n) \sim \frac{1}{4n\sqrt{3}} e^{\frac{1}{\pi} \cdot \sqrt{\frac{2}{3}} \cdot \sqrt{n}} \quad (30.6)$$

C.6.1. Диаграмма Юнга

Пусть $n = x_1 + \dots + x_t$, причём порядок неважен. Можно считать, что $x_1 \leq x_2 \leq \dots \leq x_t$.

C.6.2. Теорема Эйлера о разбиениях

Пусть нам дано формальное произведение

$$(1 + x)(1 + x^2)(1 + x^3)\dots = 1 - x^2 - x^3 + x^5 + x^6 - x^8 - x^9 + x^{11} + \dots \quad (30.7)$$

 **Теорема Эйлера.** Коэффициент при x^n , если $n = \frac{3k^2 \pm k}{2}$ равен $(-1)^k$, иначе равен нулю.

Найдём коэффициент при $(x^n) : (-x^{k_1}) \cdot (-x^{k_2}) \cdot \dots \cdot (-x^{k_t}) = (-1)^t x^{k_1+k_2+\dots+k_t}$,
 $n = k_1 + \dots + k_t$. Если n_e — число чётных слагаемых, n_o — нечётных.

 **Переформулировка.** Тогда $n_e - n_o = (-1)^k$, где $n = \frac{3k^2 \pm k}{2}$, иначе $n_e = n_o$.

C.7. Линейные рекуррентные соотношения

Пусть даны коэффициенты $a_0, a_1, \dots, a_k \in \mathbb{C}$ и последовательность $\{y_n\}_0^\infty$. Линейным рекуррентным соотношением порядка k с постоянными коэффициентами называется соотношение $\forall n :$

$$a_k y_{n+k} + a_{k-1} y_{n+k-1} + \dots + a_1 y_{n+1} + a_0 y_n = 0 \quad (31.1)$$

чтобы это имело смысл, необходимо, чтобы $a_k \neq 0$. Будем говорить, что это рекуррента k -го порядка, если $a_0 \neq 0$. Чтобы однозначно задать последовательность, необходимо задать k начальных значений y_0, y_1, \dots, y_{k-1} .

C.7.1. Случай второго порядка

Если $k = 2$, мы полагаем $a_2 \neq 0$ и $a_0 \neq 0$ и хотим решить

$$a_2 y_n + a_1 y_{n-1} + a_0 y_{n-2} = 0 \quad (31.2)$$

 Алгоритм. Чтобы решить рекурренту второго порядка, составим квадратное уравнение

$$a_2 x^2 + a_1 x + a_0 = 0 \quad (31.3)$$

и получим из него корни λ_1, λ_2 .

 **Теорема.** Пусть $\lambda_1 \neq \lambda_2$. Тогда

1. $\forall c_1, c_2 \in \mathbb{C}$ последовательность $y_n = c_1 \lambda_1^n + c_2 \lambda_2^n$ удовлетворяет исходной рекурренте.
2. Если последовательность $\{y_n\}_1^\infty$ удовлетворяет исходной рекурренте, то $\exists c_1, c_2 \in \mathbb{C}: y_n = c_1 \lambda_1^n + c_2 \lambda_2^n$.

Доказательство. \square

1. Подставим эту линейную комбинацию в исходное соотношение.

$$\begin{aligned} a_2(c_1 \lambda_1^{n+2} + c_2 \lambda_2^{n+2}) + a_1(c_1 \lambda_1^{n+1} + c_2 \lambda_2^{n+1}) + a_0(c_1 \lambda_1^n + c_2 \lambda_2^n) &= \\ &= c_1 \lambda^n(a_2 \lambda_1^2 + a_1 \lambda_1 + a_0) + c_2 \lambda^n(a_2 \lambda_2^2 + a_1 \lambda_2 + a_0) \end{aligned} \quad (31.4)$$

поэтому λ_1, λ_2 — это корни квадратного уравнения.

2. $\{y_n\}_1^\infty$ удовлетворяет исходной рекурренте. Составим СЛУ из 2 уравнений

$$\begin{cases} c_1 + c_2 = y_0 \\ c_1 \lambda_1 + c_2 \lambda_2 = y_1 \end{cases} \quad (31.5)$$

так как $\lambda_1 \neq \lambda_2$, то система определена, и пусть решения будут (c_1^*, c_2^*) . Рассмотрим последовательность $y_n^* = c_1^* \lambda_1^n + c_2^* \lambda_2^n$, и ясно, что это та же самая последовательность, что и y_n . ■

 **Теорема.** Пусть $\lambda_1 = \lambda_2 = \lambda$. Тогда

1. $\forall c_1, c_2 \in \mathbb{C}$ последовательность $y_n = (c_1 n + c_2) \lambda^n$ удовлетворяет исходной рекурренте.
2. Если последовательность y_n удовлетворяет исходной рекурренте, то $\exists c_1, c_2 : y_n = (c_1 n + c_2) \lambda^n$.

Доказательство. □

1. Подставим $y_n = (c_1 n + c_2) \lambda^n$ в рекурренту:

$$\begin{aligned} a_2(c_1(n+2) + c_2)\lambda^{n+2} + a_1(c_1(n+1) + c_2)\lambda^{n+1} + a_0(c_1n + c_2)\lambda^n = \\ = c_1n\lambda^{n(a_2\lambda^2+a_1\lambda+a_0)} + c_2\lambda^n(a_2\lambda^2 + a_1\lambda + a_0) + c_1\lambda^{n+1}(2a_2\lambda + a_1) = 0 \end{aligned} \quad (31.6)$$

2. Аналогично проверяется, что решение единствено. ■

C.7.2. Общий случай

Пусть дана рекуррента k -го порядка

$$a_k y_{n+k} + a_{k-1} y_{n+k-1} + \dots + a_1 y_{n+1} + a_0 y_n = 0 \quad (31.7)$$

Составим с коэффициентами a_i характеристическое уравнение.

$$a_k x^k + a_{k-1} x^{k-1} + \dots + a_1 x + a_0 = 0 \quad (31.8)$$

Согласно основной теореме алгебры, у этого уравнения ровно k корней над полем \mathbb{C} , пусть $a_k(x - \lambda_1)(x - \lambda_2) \cdot \dots \cdot (x - \lambda_k) = 0$.

 **Теорема.** За μ_1, \dots, μ_r обозначим все различные числа среди $\lambda_1, \dots, \lambda_k$. Обозначим k_1, \dots, k_r кратности корней характеристического многочлена. Тогда $k = k_1 + \dots + k_r$. Обозначим $P_m(n) = c_m n^m + \dots + c_1 n + c_0$, причём $\deg P_m \leq n$.

1. $\forall P_{k_1-1}(n), \dots, P_{k_r-1}$ последовательность

$$y_n = P_{k_1-1}(n)\mu_1^n + \dots + P_{k_r-1}(n)\mu_r^n \quad (31.9)$$

удовлетворяет исходному соотношению.

2. Если $\{y_n\}_1^\infty$ удовлетворяет исходной рекурренте, то $\exists P_{k_1-1}(n), \dots, P_{k_r-1}(n) :$

$$y_n = P_{k_1-1}(n)\mu_1^n + \dots + P_{k_r-1}(n)\mu_r^n. \quad (31.10)$$

C.8. Формальные степенные ряды и производящие функции

Определение. Формальный степенной ряд — это последовательность $a_1, a_2, \dots, a_n, \dots$.

Можно представлять его как формальное выражение $a_1 + a_2x + a_3x^2 + \dots$.

Обозначим \mathcal{F} множество всех формальных степенных рядов.

Операции над формальными степенными рядами

1. $A + B = (a_0 + b_0, a_1 + b_1, \dots)$
2. $\lambda \cdot A = (\lambda a_0, \lambda a_1, \dots)$
3. $A \cdot B = (a_0b_0, a_0b_1 + a_1b_0, \dots, a_0b_n + \dots + a_nb_0, \dots)$
4. $\frac{A}{B} = C \Leftrightarrow B \cdot C = A$. Для этого надо $b_0 \neq 0$

Такая структура называется алгеброй.

C.8.1. Примеры

1. Разделим формальные степенные ряды: 1 на $1 - x$:

$$\frac{1}{1-x} = 1 + x + x^2 + \dots \quad (32.1)$$

2. Рассмотрим отношение $\left(\frac{1}{1-x^2}\right)^2$. Согласно предыдущему тождеству имеем:

$$\left(\frac{1}{1-x^2}\right)^2 = (1 + x^2 + x^4 + x^6 + \dots)^2 = 1 + 2x^2 + 3x^4 + \dots + (n+1)x^{2n} \quad (32.2)$$

Но с другой стороны,

$$\begin{aligned} & \left(\frac{1}{1-x}\right)^2 \left(\frac{1}{1+x}\right)^2 = (1 + x + x^2 + \dots)^2 (1 - x + x^2 + \dots + (-1)^n x^n)^2 = \\ & = (1 + 2x + 3x^2 + \dots + (n+1)x^n + \dots) (1 - 2x + 3x^2 + \dots + (-1)^n(n+1)x^n) \stackrel{(32.1)}{=} \\ & = \dots + x^n (1 \cdot (-1)^n \cdot (n+1) + 2 \cdot (-1)^{n-1} \cdot n + \dots + (n+1) \cdot (-1)^0 \cdot (n+1-n)). \end{aligned}$$

Тогда

$$\sum_{k=0}^n (k+1) \cdot (-1)^n \cdot (n+1-k) = \begin{cases} 0, & \text{если } 2 \nmid n \\ 2l, & \text{иначе} \end{cases} \quad (32.4)$$

C.8.2. Производящие функции

Определение. Производящая функция последовательности $\{a\}_0^\infty$ это степенной ряд

$$f(x) = \sum_{n=0}^{\infty} a_n x^n \quad (32.5)$$

в аналитическом смысле.

 **Теорема(Коши-Адамара).** Пусть

$$\rho = \left(\overline{\lim}_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n]{|a_n|} \right)^{-1} \quad (32.6)$$

тогда $\forall x_0 : |x_0| < \rho$ ряд $\sum a_n x^n$ сходится, а $\forall x_0 : |x_0| > \rho$ ряд $\sum a_n x^n$ расходится.

Причём ряд можно почленно дифференцировать внутри области сходимости.

Примеры применения производящих функций:

1. Найдём сумму:

$$\sum_{k=0}^n k^2 C_n^k \cdot \left(\frac{2}{3}\right)^k \quad (32.7)$$

Рассмотрим сумму $\sum_{k=0}^n k^2 C_n^k x^k$. Введём функцию f :

$$f(x) = \sum_{k=0}^n C_n^k x^k = (1+x)^n. \quad (32.8)$$

Её производная равна

$$f'(x) = \sum_{k=0}^n k C_n^k x^{k-1}. \quad (32.9)$$

Домножим на x и возьмём производную ещё раз:

$$(x \cdot f'(x))' = \left(\sum_{k=0}^n k C_n^k x^k \right)' = \sum_{k=0}^n k^2 C_n^k x^{k-1} \quad (32.10)$$

Тогда

$$x \cdot (x \cdot f'(x))' = \sum_{k=0}^n k^2 C_n^k x^k. \quad (32.11)$$

Имея в виду, что $f'(x) = ((1+x)^n)' = n(1+x)^{n-1}$ и $f''(x) = n \cdot (n-1) \cdot (1+x)^{n-2}$, получим

$$\begin{aligned} x \cdot (x \cdot f'(x))' &= x \cdot (f'(x) + x \cdot f''(x)) = \\ &= x \cdot n \cdot (1+x)^{n-1} + x^2 \cdot n \cdot (n-1) \cdot (1+x)^{n-2} \end{aligned} \quad (32.12)$$

подставляем $x = \frac{2}{3}$ и получаем ответ для такой задачи.

2. Пусть F_n – последовательность чисел Фибоначчи с $F_0 = 0, F_1 = 1$. Найдём

$$\sum_{n=0}^{\infty} n^2 \cdot F_n \cdot \left(\frac{1}{3}\right)^n \quad (32.13)$$

Введём производящую функцию для чисел Фибоначчи:

$$f(x) = F_0 + F_1 x + F_2 x^2 + \dots \quad (32.14)$$

$$x \cdot f(x) = x \cdot F_0 + F_1 x^2 + \dots + F_n x^{n+1} + \dots \quad (32.15)$$

$$x^2 f(x) = x^2 \cdot F_0 + F_1 x^3 + \dots + F_n x^{n+2} + \dots \quad (32.16)$$

Сложим $x \cdot f(x)$ и $x^2 f(x)$:

$$x \cdot f(x) + x^2 f(x) = F_0 x + (F_0 + F_1)x^2 + (F_1 + F_2)x^3 + \dots + (F_{n-2} + F_{n-1})x^{n+1} \quad (32.17)$$

Итак,

$$x f(x) + x^2 f(x) = f(x) - x \Rightarrow f(x) = \frac{x}{1 - x - x^2} \quad (32.18)$$

Теперь аналогично выражаем степенной ряд через производящую функцию и получаем ответ.

C.8.3. Числа Каталана

Определение. Числами Каталана называются элементы последовательности $\{T_n\}_0^\infty$, определённые рекуррентой:

$$\begin{aligned} T_n &= T_0 T_{n-1} + T_1 T_{n-2} + \dots + T_{n-1} T_0, \\ T_0 &= 1 \end{aligned} \quad (32.19)$$

 *Теорема.* Формула для чисел Каталана

$$T_n = \frac{1}{n+1} C_{2n}^n \quad (32.20)$$

Доказательство. □ Запишем производящую функцию для этой последовательности, работая с ней как с формальным степенным рядом

$$f(x) = T_0 + T_1 x + T_2 x^2 + \dots \quad (32.21)$$

Рассмотрим квадрат производящей функции:

$$\begin{aligned} f^2(x) &= T_0^2 + (T_0 T_1 + T_1 T_0) \cdot x + \dots + (T_0 T_n + \dots + T_n T_0) x^n + \dots = \\ &= T_1 + T_2 x + \dots + T_{n+1} x^n + \dots \end{aligned} \quad (32.22)$$

$$xf^2(x) = f(x) - 1 \quad (32.23)$$

отсюда

$$x \cdot f_{1,2} = \frac{1 \pm \sqrt{1 - 4x}}{2} \quad (32.24)$$

Вариант с плюсом не подходит, так как при $x = 0$ получается противоречие. Итак, ПФ чисел Каталана равна

$$f(x) = \frac{1 - \sqrt{1 - 4x}}{2x}. \quad (32.25)$$

Можно показать, что корень из формального степенного ряда, определённый по правилу $B = \sqrt{A} \Leftrightarrow B \cdot B = A$, работает для $(1 + x)^{\frac{1}{2}}$ так:

$$(1 + x)^{\frac{1}{2}} = 1 + C_{\frac{1}{2}}^1 x + C_{\frac{1}{2}}^2 x^2 + \dots \quad (32.26)$$

То есть формальный степенной ряд совпадает с рядом Тейлора для функции $\sqrt{1 + x}$.

Напишем ряд для $\sqrt{1 - 4x}$ и посмотрим на коэффициенты при степенях больше нуля

$$\sqrt{1 - 4x} = \dots + C_{\frac{1}{2}}^n (-4)^n x^n + \dots \quad (32.27)$$

$$\begin{aligned} C_{\frac{1}{2}}^n (-4)^n &= \frac{\frac{1}{2} \cdot (\frac{1}{2} - 1) \cdot \dots \cdot (\frac{1}{2} - n + 1) \cdot (-4)^n}{n!} = \frac{(-1)^n \cdot 4^n}{2^n \cdot n!} \cdot (-1)^{n-1} \cdot (2n - 3)!! = \\ &= -\frac{2^n}{n!} \cdot \frac{(2n - 2)!}{2 \cdot 4 \cdot 6 \cdot \dots \cdot (2n - 2)} = -\frac{2^n}{n!} \cdot \frac{(2n - 2)!}{2^{n-1} \cdot (n - 1)!} = -2 \cdot \frac{(2n - 2)!}{n!(n - 1)!} = -\frac{2}{n} C_{2n-2}^{n-1} \end{aligned} \quad (32.28)$$

Итак, коэффициент при x^n у функции $f(x)$ будет $(-\frac{1}{2}) \cdot (-\frac{2}{n}) C_{2n-2}^{n-1} = \frac{1}{n} C_{2n-2}^{n-1} = T_{n-1}$. ■

C.9. Основы теории графов

Определение. Граф — это пара множеств (V, E) , где элементы $v \in V$ называются вершинами, а элементы $e \in E$ — рёбрами, причём $E \subseteq V^2$.

Определение. Граф $G(V, E)$ называется простым, если

1. $\forall x \in V : (x, x) \notin E$ (нет петель).
2. $\forall x, y \in V : (x, y) = (y, x)$ (неориентированный).
3. $E \subseteq 2^V$ (нет кратных рёбер).

Определение.

1. Граф с ориентацией называется орграфом.
2. Граф, где есть петли, называется псевдографом.
3. Граф, где есть кратные рёбра, называется мультиграфом.

Будем считать, что граф = простой граф.

Определение. Маршрут в графе — это последовательность $v_1 e_1 v_2 e_2 \dots v_n e_n v_{n+1}$, где все $v_i \in V$, и все $e_i \in E$.

Определение. Маршрут $v_1 e_1 v_2 e_2 \dots v_n e_n v_{n+1}$ называется замкнутым, если $v_1 = v_{n+1}$.

Определение. Если в замкнутом маршруте все рёбра e_i разные, то он называется циклом, а если все вершины(\Rightarrow рёбра) кроме v_1 и v_{n+1} разные, то он называется простым циклом.

Определение. Если в незамкнутом маршруте $v_1 e_1 v_2 e_2 \dots v_n e_n v_{n+1}$ все рёбра разные, то он называется цепью(путём). Если дополнительно все вершины разные, то он называется простой цепью или простым путём.

Определение. Граф называется связным, если между любыми двумя его вершинами существует маршрут.

Определение. Степенью вершины $v \in V$ называется число рёбер, инцидентных с ней. Обозначается $\deg v$.

Очевидно, что для любого графа $G(V, E)$

$$\sum_{v \in V} \deg v = 2 \cdot |E|. \quad (33.1)$$

C.9.1. Деревья

Определение. Дерево — это связный граф без циклов.

Определение. Лист дерева — вершина степени 1. У любого дерева с больше чем одной вершиной есть листья.

 **Теорема.** Пусть $G(V, E)$ – граф. Следующие 4 утверждения попарно эквивалентны:

1. G – дерево.
2. $\forall v, w \in V \exists!$ цепь, соединяющая v и w .
3. G связен и $|E| = |V| - 1$.
4. G ацикличен и $|E| = |V| - 1$.

Эквивалентность можно очевидно доказать по циклу $1 \Rightarrow 2 \Rightarrow 3 \Rightarrow 4 \Rightarrow 1$.

 **Теорема(Формула Кэли).** Пусть t_n – число деревьев на n вершинах. Тогда $t_n = n^{n-2}$.

Доказательство. \square Будем использовать коды Прюфера. Для любого дерева с больше чем одной вершиной поступим по такому алгоритму. Пусть у нас есть дерево на n вершинах.

1. Выберем из всех листьев текущего дерева лист с наименьшим номером.
2. Удалим выбранный лист и инцидентное ему ребро. Запишем в код справа номер единственного соседа удалённого листа.
3. Повторить с пункта 1, пока в дереве не останется 2 вершины.

Получили для данного дерева код длины $(n - 2)$. Алгоритм декодирования выглядит так:

1. Запишем код Прюфера p_{n-2} и под ним кортеж из первых n натуральных чисел $s_n = (1, \dots, n)$.
2. Будем для каждого следующего числа $x \in p_{n-2}$ будем искать в s_n наименьший номер y , которого нет в p_{n-2} . Записываем в ответ пару (x, y) – это ребро. Удаляем из p_n номер x и из s_n номер y .
3. Повторяем шаг 2 с получившимися s_n и p_{n-2} при $n \rightarrow (n - 1)$, пока p_n не пуст.
4. Когда p_n пуст, остаётся в s_n только 2 ребра, выписываем их в ответ.

Можно доказать, что такое отображение из множества деревьев в множество из n^{n-2} кодов биективно. Отсюда следует формула Кэли. ■

Определение. Лесом называется ациклический граф, который состоит из одного или нескольких непересекающихся деревьев.

 **Теорема.** Пусть $F(n, k)$ – количество лесов на n вершинах из k компонент связности. Тогда

$$F(n, k) = k \cdot n^{n-k-1} \quad (33.2)$$

C.9.2. Унициклические графы

Определение. Связный граф называется унициклическим, если в нём ровно один простой цикл.

Определение. Обозначим $C(n, k)$ связных количества графов на n вершинах, в которых ровно k рёбер.

- Если $k < n - 1$, то граф не связан и $C_{n,k} = 0$
- Если $k = n - 1$, то $C(n, n - 1) = t_n = n^{n-2}$ (количество деревьев).
- Если $k = n$, то $C(n, n)$ – количество унициклических графов.

Найдём $C(n, n)$. Так как петель и кратных ребёр нет, то минимальный цикл это треугольник.

$$C(n, n) = \sum_{k=3}^n C_n^k \cdot \frac{(k-1)!}{2} \cdot F(n, k), \quad (33.3)$$

где $F(n, k)$ – количество лесов на n вершинах с k компонентами связности.

Итак,

 **Теорема.** Количество унициклических графов на n вершинах равно

$$C(n, n) = \sum_{k=3}^n C_n^k \frac{(k-1)!}{2} \cdot k \cdot n^{n-k-1} \quad (33.4)$$

D. Теория вероятностей

D.1. Основные понятия

Определение. Случайный эксперимент это эксперимент, который обладает тремя свойствами

1. Повторяемость.
2. Отсутствие детерминистической регулярности.
3. Статистическая устойчивость частот.

Определение. Элементарным исходом w_i называется результат случайного эксперимента. Все элементарные исходы образуют пространство элементарных исходов конечное или бесконечное множество Ω , причём элементарные исходы не могут происходить одновременно.

Определение. Вероятностным пространством называется тройка $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbf{P})$, где Ω – множество, \mathcal{F} – множество

$$\mathcal{F} = \{A \mid A \subseteq \Omega\}, \quad (34.1)$$

удовлетворяющее требованиям:

1. \mathcal{F} замкнуто относительно операций \cap, \cup, \setminus .
2. $\forall A_1, A_2, \dots \in \mathcal{F} :$

$$\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n \in \mathcal{F}, \quad (34.2)$$

а \mathbf{P} – функция: $\mathcal{F} \rightarrow [0, 1]$, удовлетворяющая требованиям:

1. $\mathbf{P}(\Omega) = 1$
2. $\forall A_1, \dots, A_n, \dots \in \mathcal{F} :$

$$\mathbf{P}\left(\bigsqcup_{n=1}^{\infty} A_n\right) = \sum_{n=1}^{\infty} \mathbf{P}(A_n) \quad (34.3)$$

\mathcal{F} называется сигма-алгеброй событий, а \mathbf{P} – вероятностной мерой.

D.1.1. Следствия аксиом вероятности

1. $\mathbf{P}(\emptyset) = 0$.

Доказательство. $\square \forall A \in \mathcal{F} : A \text{ и } \emptyset \text{ – несовместные события} (A \cap \emptyset = \emptyset)$, значит по аксиоме аддитивности:

$$\mathbf{P}(A) = \mathbf{P}(A \cup \emptyset) = \mathbf{P}(A) + \mathbf{P}(\emptyset). \quad (34.4)$$

Откуда $\mathbf{P}(\emptyset) = 0$. ■

2. $\mathbf{P}(\overline{A}) + \mathbf{P}(A) = 1$.

Доказательство. □ Пользуясь аксиомой нормировки и аддитивности, получаем:

$$1 = \mathbf{P}(\Omega) = \mathbf{P}(A \cup \overline{A}) = \mathbf{P}(A) + \mathbf{P}(\overline{A}). \quad (34.5)$$

3. $\mathbf{P}(A \cup B) = \mathbf{P}(A) + \mathbf{P}(B) - \mathbf{P}(A \cap B)$.

Доказательство. □ По аксиоме аддитивности: $\mathbf{P}(A \cup B) = \mathbf{P}(A) + \mathbf{P}(\overline{A} \cap B)$.

Заметим, что $\overline{A} \cap B = B \setminus (A \cap B)$, значит:

$$\mathbf{P}(\overline{A} \cap B) = \mathbf{P}(B) - \mathbf{P}(A \cap B). \quad (34.6)$$

Подставляя это в предыдущее равенство, получаем требуемое. ■

D.1.2. Полная группа попарно несовместных событий

Определение. Конечная или счётная совокупность событий $A_1, A_2, \dots, A_n, \dots$, таких, что $\forall i \neq j : A_i \cap A_j = \emptyset$ и $\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n = \Omega$ называется полной группой попарно несовместных событий.

Если фактически совокупность конечна, её можно считать счётной, просто все события, за исключением конечного числа, будут \emptyset .

D.1.3. Классическое определение и прямой способ подсчёта

Определение. Если в вероятностном пространстве $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbf{P})$ множество Ω конечно и все элементарные исходы равновозможны, то вероятность события $A \in \mathcal{F}$, состоящего из конечного числа элементарных исходов, определяется

$$\mathbf{P}(A) := \frac{|A|}{|\Omega|}. \quad (34.7)$$

Нетрудно проверить, что такое определение вероятности удовлетворяет аксиомам вероятности.

Пример. В урне лежат 5 красных и 3 синих шара. Наудачу вытаскивается один шар. Найти вероятность того, что шар окажется красным.

Решение: $\Omega = \{1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8\}$ — множество элементарных исходов. $A = \{1, 2, 3, 4, 5\}$ — множество элементарных исходов благоприятствующих событию «вытащили красный шар». Тогда $\mathbf{P}(A) = \frac{|A|}{|\Omega|} = \frac{5}{8}$.

Пример 2. Из колоды 36 карт случайно вынимают 2 карты. Найти вероятность, что хотя бы одна из них — пика.

Решение: Пусть A — событие, что хотя бы одна карта пика. Найдём $P(\bar{A})$ — вероятность того, что ни одна карта не пика. Всего способов выбрать 2 карты из 36: C_{36}^2 . Способов выбрать 2 карты, не являющиеся пиками: C_{27}^2 . Тогда

$$P(A) = 1 - P(\bar{A}) = 1 - \frac{C_{27}^2}{C_{36}^2} = 1 - \frac{39}{70} = \frac{31}{70}. \quad (34.8)$$

Имеет место так называемая *гипергеометрическая формула*. Если из N элементов, из которых M благоприятны событию A , выбирается наудачу n элементов, то вероятность того, что ровно k из выбранных элементов благоприятны событию A , равна

$$P(A) = \frac{C_M^k \cdot C_{N-M}^{n-k}}{C_N^n}. \quad (34.9)$$

D.1.4. Геометрическая вероятность

Пусть $\Omega \subset \mathbb{R}^n$ — подмножество n -мерного евклидова пространства, имеющее конечную меру $\mu(\Omega) < +\infty$. Пусть $A \subseteq \Omega$ — его измеримое подмножество с мерой $\mu(A)$. Тогда геометрическая вероятность события A определяется как

$$P(A) := \frac{\mu(A)}{\mu(\Omega)}. \quad (34.10)$$

Можно проверить, что такое определение вероятности удовлетворяет аксиомам вероятности.

D.1.5. Зависимые и независимые события. Теоремы + и ·

Определение. События A и B называются независимыми, если $P(A \cap B) = P(A) \cdot P(B)$. В противном случае события называются зависимыми.

Свойства:

1. (A, B) независимы $\Rightarrow (\bar{A}, B), (A, \bar{B}), (\bar{A}, \bar{B})$ независимы.
2. Если несовместные события A и B не являются невозможными, то они зависимы, так как $P(A) \cdot P(B) > 0$, но $P(A \cap B) = 0$.

Определение. Условной вероятностью события A при условии, что произошло событие B называется величина

$$P(A | B) := \frac{P(A \cap B)}{P(B)}, \quad P(B) > 0. \quad (34.11)$$

Теорема умножения вероятностей. Для любых событий A и B верно

$$\mathbf{P}(A \cap B) = \mathbf{P}(A | B) \cdot \mathbf{P}(B) = \mathbf{P}(B | A) \cdot \mathbf{P}(A). \quad (34.12)$$

Теорема сложения вероятностей. Для любых событий A и B верно

$$\mathbf{P}(A \cup B) = \mathbf{P}(A) + \mathbf{P}(B) - \mathbf{P}(A \cap B). \quad (34.13)$$

D.2. Условная вероятность, независимость и схема испытаний

Бернулли

D.2.1. Формула полной вероятности

Как было определено в прошлой главе, $\mathbf{P}(A \mid B) := \frac{\mathbf{P}(A \cap B)}{\mathbf{P}(B)}$, $\mathbf{P}(B) > 0$.

Пусть события H_1, H_2, \dots, H_n образуют полную группу попарно несовместных событий, то есть $H_i \cap H_j = \emptyset \forall i \neq j$ и $\bigcup_{i=1}^n H_i = \Omega$. Тогда для любого события $A \in \mathcal{F}$ верно

$$\mathbf{P}(A) = \sum_{i=1}^n \mathbf{P}(A \mid H_i) \mathbf{P}(H_i). \quad (35.1)$$

Эта формула называется формулой полной вероятности.

D.2.2. Формула Байеса

При тех же условиях, можно выразить условную вероятность $\mathbf{P}(H_k \mid A)$ через $\mathbf{P}(A \mid H_k)$:

$$\mathbf{P}(H_k \mid A) = \frac{\mathbf{P}(A \mid H_k) \mathbf{P}(H_k)}{\mathbf{P}(A)} = \frac{\mathbf{P}(A \mid H_k) \mathbf{P}(H_k)}{\sum_{i=1}^n \mathbf{P}(A \mid H_i) \mathbf{P}(H_i)}. \quad (35.2)$$

D.2.3. Схема испытаний Бернулли

Рассмотрим n независимых испытаний, в каждом из которых событие A происходит с вероятностью p , а не происходит с вероятностью $q = 1 - p$. Тогда вероятность того, что событие A произойдет ровно k раз, вычисляется по формуле

$$\mathbf{P}_n(k) = C_n^k p^k q^{n-k}. \quad (35.3)$$

Доказательство. \square Из n испытаний выберем k , в которых событие A произойдет. Вероятность того, что в этих испытаниях событие A произойдет, равна p^k , а в остальных $n - k$ испытаниях событие A не произойдет с вероятностью q^{n-k} . Поскольку испытания независимы, вероятность такого исхода равна произведению вероятностей отдельных испытаний, то есть $p^k q^{n-k}$. Число способов выбрать k испытаний из n равно C_n^k . Таким образом, общая вероятность того, что событие A произойдет ровно k раз, равна $C_n^k p^k q^{n-k}$. ■

Определение. Наивероятнейшим числом успехов в схеме испытаний Бернулли для n испытаний называется число m_0 , равное

$$m_0 = \arg \max_{\substack{0 \leq k \leq n, \\ k \in \mathbb{Z}}} \mathbf{P}_n(k). \quad (35.4)$$

Рассмотрим отношение

$$\frac{\mathbf{P}_n(k)}{\mathbf{P}_n(k-1)} = \frac{C_n^k p^k q^{n-k}}{C_n^{k-1} p^{k-1} q^{n-k+1}} = \frac{n-k+1}{k} \cdot \frac{p}{q}. \quad (35.5)$$

- Если $\frac{\mathbf{P}_n(k)}{\mathbf{P}_n(k-1)} \geq 1$, то последовательность $\mathbf{P}_n(k)$ возрастает при увеличении k . Это тоже самое, что $k \leq np + p$
- Если $\frac{\mathbf{P}_n(k)}{\mathbf{P}_n(k-1)} \leq 1$, то последовательность $\mathbf{P}_n(k)$ убывает при увеличении k . Это тоже самое, что $k \geq np - q$.

Следовательно, $k = m_0$ доставляющее максимум должно удовлетворять двойному неравенству

$$np - q \leq m_0 \leq np + p. \quad (35.6)$$

1. Если $(np - q) \in \mathbb{Z}$, то наивероятнейших чисел успехов два: $m_0 = np - q$ и $m_0 = np + p$. $\mathbf{P}_n(m_0) = \mathbf{P}_n(m_0 + 1)$.
2. Если $(np - q) \notin \mathbb{Z}$, то наивероятнейшее число успехов одно: $m_0 = \lfloor np + p \rfloor$.

Пример. Пусть мы подбросили честную монету 10 раз. Каково наивероятнейшее число выпадений орла?

Решение. Поскольку монета честная, $p = q = \frac{1}{2}$. Тогда наивероятнейшее число выпадений орла m_0 должно лежать на отрезке $[np - q, np + p]$. То есть на отрезке $[10 \cdot \frac{1}{2} - \frac{1}{2}, 10 \cdot \frac{1}{2} + \frac{1}{2}] = [4.5, 5.5]$. Поскольку на этом отрезке только одно целое число 5, то $m_0 = 5$. Максимальная вероятность выпадения орла ровно 5 раз равна

$$\mathbf{P}_{10}(5) = C_{10}^5 \left(\frac{1}{2}\right)^5 \left(\frac{1}{2}\right)^{10-5} = C_{10}^5 \left(\frac{1}{2}\right)^{10} = \frac{252}{1024} \approx 0.246. \quad (35.7)$$

D.2.4. Асимптотические оценки вероятностей в схеме Бернулли

 *Формула Пуассона.* Пусть в схеме испытаний Бернулли число испытаний $n \rightarrow \infty$. Определим $\lambda := np$. Тогда для любого фиксированного $k \in \mathbb{Z}_0^+$ верно

$$\mathbf{P}_n(k) \sim \frac{\lambda^k}{k!} e^{-\lambda}. \quad (35.8)$$

Доказательство. \square Запишем вероятность $\mathbf{P}_n(k)$ в виде

$$\mathbf{P}_n(k) = \frac{n!}{(n-k)!k!} p^k (1-p)^{n-k} = \frac{1}{k!} \frac{n!}{(n-k)!} p^k (1-p)^{n-k}. \quad (35.9)$$

Заметим, что $\frac{n!}{(n-k)!} = n(n-1)\dots(n-k+1) = n^k (1 - \frac{1}{n})(1 - \frac{2}{n})\dots(1 - \frac{k-1}{n}) \sim n^k$.

Итак, $\frac{n!}{(n-k)!} p^k \sim n^k p^k = \lambda^k$. Далее оценим остаток:

$$\begin{aligned} \ln((1-p)^{n-k}) &= (n-k) \ln(1-p) = (n-k) \ln\left(1 - \frac{\lambda}{n}\right) = \\ &= (n-k) \left(-\frac{\lambda}{n} + o\left(\frac{1}{n}\right)\right) = -\lambda + o(1). \end{aligned} \quad (35.10)$$

Поэтому $(1-p)^{n-k} = e^{-\lambda+o(1)} \sim e^{-\lambda}$. Собирая все вместе, получаем

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \mathbf{P}_n(k) = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{k!} \lambda^k e^{-\lambda} = \frac{\lambda^k}{k!} e^{-\lambda}. \blacksquare \quad (35.11)$$

Пример. Рассмотрим схему испытаний Бернулли с $n = 1000$ и $p = 0.01$. Найдем приближенное значение вероятности того, что событие произойдет ровно $k = 3$ раза.

Решение. Сначала вычислим $\lambda = np = 1000 \cdot 0.01 = 10$. По формуле Пуассона получаем

$$\mathbf{P}_{1000}(3) \approx \frac{10^3}{3!} e^{-10} = \frac{1000}{6} e^{-10} \approx 0.00757. \quad (35.12)$$

 Интегральная формула Муавра-Лапласа. Пусть в схеме испытаний Бернулли число испытаний $n \rightarrow \infty$, $p \in (0, 1)$, $q = 1 - p$ и m – число успехов. Тогда $\forall a, b \in \mathbb{R}$

$$\mathbf{P}_n\left(a \leq \frac{m - np}{\sqrt{npq}} \leq b\right) \sim \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_a^b e^{-\frac{x^2}{2}} dx = \Phi_0(b) - \Phi_0(a). \quad (35.13)$$

Здесь $\Phi_0(x)$ – функция Лапласа:

$$\Phi_0(x) := \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^x e^{-\frac{t^2}{2}} dt. \quad (35.14)$$

Пример. Пусть честную монету подбросили 1000 раз. Найдем приближенное значение вероятности того, что выпадет от 480 до 520 орлов.

Решение. Поскольку монета честная, $p = q = \frac{1}{2}$. Тогда $np = 1000 \cdot \frac{1}{2} = 500$, $\sqrt{npq} = \sqrt{1000 \cdot \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{2}} = 15.81$. Нам нужно найти вероятность события $480 \leq m \leq 520$. Приведем это событие к стандартному виду:

$$\begin{aligned}\mathbf{P}_n(480 \leq m \leq 520) &= \mathbf{P}_n\left(\frac{480 - 500}{15.81} \leq \frac{m - 500}{15.81} \leq \frac{520 - 500}{15.81}\right) = \\ &= \mathbf{P}_n\left(-1.26 \leq \frac{m - 500}{15.81} \leq 1.26\right).\end{aligned}\tag{35.15}$$

По интегральной формуле Муавра-Лапласа получаем

$$\mathbf{P}_n\left(-1.26 \leq \frac{m - 500}{15.81} \leq 1.26\right) \sim \Phi_0(1.26) - \Phi_0(-1.26) = 2\Phi_0(1.26) - 1.\tag{35.16}$$

По таблице значений функции Лапласа $\Phi_0(1.26) \approx 0.8962$. Следовательно,

$$\mathbf{P}_n(480 \leq m \leq 520) \approx 2 \cdot 0.8962 - 1 = 0.7924.\tag{35.17}$$

D.3. Случайные величины

Определение. Пусть задано вероятностное пространство $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbf{P})$. Случайной величиной назовём измеримую функцию $\xi : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$, то есть $\forall x \in \mathbb{R} : \{\omega : \xi(\omega) \leq x\} \in \mathcal{F}$.

Будем обозначать случайные величины прописными греческими буквами (ξ, η, \dots).

1. Для дискретных случайных величин множество значений или конечно, или бесконечно, но счётно.
2. Для непрерывных случайных величин множество значений равнomoщно \mathbb{R} .

Универсальным законом распределения случайных величин является *функция распределения*(ф. р.).

Определение. Функция распределения F_ξ для случайной величины ξ определяется как вероятность события $\{\xi < x\}$.

$$F_\xi := \mathbf{P}(\xi < x) \quad (36.1)$$

D.3.1. Свойства функции распределения случайной величины

Пусть ξ - случайная величина.

1. $0 \leq F_\xi(x) \leq 1, \forall x \in \mathbb{R}$,
2. $F_\xi(-\infty) = F_\xi(\xi < -\infty) = 0$,
3. $F_\xi(+\infty) = F_\xi(\xi < \infty) = 1$,
4. $F_\xi \nearrow$ (функция распределения монотонно не убывает на всей области определения).

□ Пусть $x_1 < x_2$ и x_1, x_2 входят в область значений случайной величины ξ . Тогда $F_\xi(x_2) = \mathbf{P}(\xi < x_2) = \mathbf{P}(\{\xi < x_1\} \cup \{x_1 \leq \xi < x_2\}) = \mathbf{P}(\xi < x_1) + \mathbf{P}(x_1 \leq \xi < x_2) \geq \mathbf{P}(\xi < x_1) = F_\xi(x_1)$ ■

5. Вероятность попадания случайной величины ξ в полуинтервал $[a, b)$ вычисляется по формуле:

$$\mathbf{P}(a \leq \xi < b) = F_\xi(b) - F_\xi(a). \quad (36.2)$$

D.3.2. Законы распределения дискретных случайных величин

Для дискретных случайных величин функция распределения имеет вид ступенчатой функции. Кроме того, для дискретных случайных величин можно ввести понятие *функции вероятности* и *ряда распределения*.

Определение. Функция вероятности p_ξ дискретной случайной величины ξ , принимающей значения $x_1, x_2, \dots, x_n, \dots$ определяется как вероятность того, что случайная величина примет значение x_i .

$$p_\xi(x_i) := \mathbf{P}(\xi = x_i), \quad i = 1, 2, \dots \quad (36.3)$$

Определение. Рядом распределения дискретной случайной величины ξ называется совокупность всех её значений и соответствующих им значений функции вероятности.

Его удобно записывать в виде таблицы:

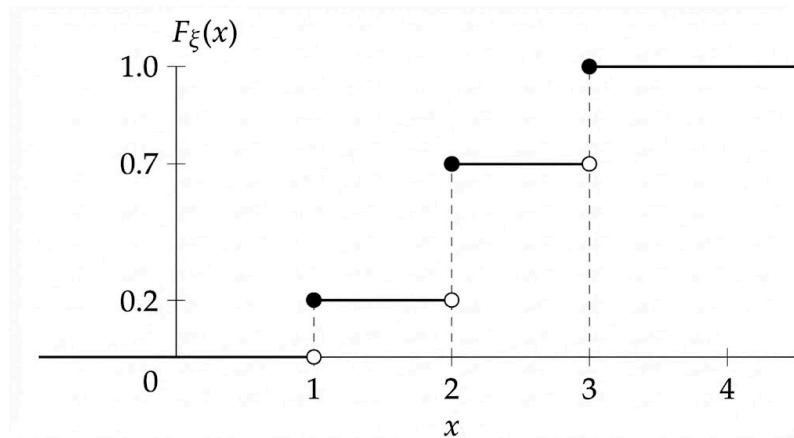
ξ	x_1	x_2	x_3	\dots	x_n
p_ξ	$p_\xi(x_1)$	$p_\xi(x_2)$	$p_\xi(x_3)$	\dots	$p_\xi(x_n)$

Определение. Многоугольником распределения дискретной случайной величины ξ называется ломаная линия, соединяющая точки с координатами $(x_i, F_\xi(x_i))$, $i = 1, 2, \dots$

Пример. Пусть случайная величина ξ принимает значения 1, 2, 3 с вероятностями 0.2, 0.5, 0.3 соответственно. Тогда её функция распределения имеет вид:

$$F_\xi(x) = \begin{cases} 0, & x < 1 \\ 0.2, & 1 \leq x < 2 \\ 0.7, & 2 \leq x < 3 \\ 1, & x \geq 3 \end{cases} \quad (36.4)$$

График функции распределения изображён на рисунке ниже.

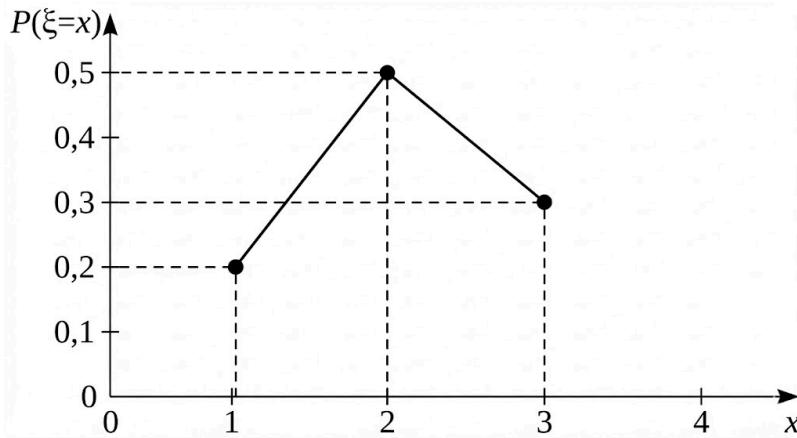


Её ряд распределения представлен в таблице:

ξ	1	2	3
-------	---	---	---

p_ξ	0,2	0,5	0,3
---------	-----	-----	-----

Многоугольник распределения изображён на рисунке ниже.



D.3.3. Распределение Бернулли. Индикатор. Биномиальное распределение

Определение. Случайная величина ξ имеет распределение Бернулли с параметром p , если она принимает значения 0 и 1 с вероятностями $1 - p$ и p соответственно.

Функция вероятности $p_\xi : \{0, 1\} \rightarrow \{1 - p, p\}$:

$$p_\xi(0) = 1 - p, \quad p_\xi(1) = p \quad (36.5)$$

Функция распределения:

$$F_\xi(x) = \begin{cases} 0, & x < 0 \\ 1 - p, & 0 \leq x < 1 \\ 1, & x \geq 1 \end{cases} \quad (36.6)$$

Определение. Случайная величина I_A называется индикатором события A , если она равна единице, если событие произошло, и нулю, если не произошло.

Определение. Случайная величина ξ имеет биномиальное распределение с параметрами n и p , если она равна числу успехов в серии из n независимых испытаний Бернулли с вероятностью успеха p . Обозначается $\xi \sim \text{Bin}(n, p)$.

Возможные значения: $k = 0, 1, 2, \dots, n$.

Вероятность значения k : $\mathbf{P}(\xi = k) = C_n^k p^k (1 - p)^{n-k}$.

Функция распределения:

$$F_\xi(x) = \sum_{k=0}^{\lfloor x \rfloor} C_n^k p^k (1 - p)^{n-k} \quad (36.7)$$

Математическое ожидание: $\mathbb{E}(\xi) = np$.

Дисперсия: $\mathbb{D}(\xi) = np(1 - p)$.

D.3.4. Неограниченное число испытаний в схеме Бернулли. Распределение Пуассона

Если в распределении Бернулли число испытаний $n \rightarrow \infty$, то биномиальное распределение приближается к распределению Пуассона.

Определение. Случайная величина ξ имеет распределение Пуассона с параметром $\lambda > 0$, если её функция вероятности задаётся формулой:

$$p_\xi(k) = \frac{\lambda^k e^{-\lambda}}{k!}, \quad k = 0, 1, 2, \dots \quad (36.8)$$

Обозначается $\xi \sim \text{Pois}(\lambda)$.

Матожидание и дисперсия случайной величины с распределением Пуассона равны λ : $\mathbb{E}(\xi) = \mathbb{D}(\xi) = \lambda$.

Определение. Случайная величина ξ имеет геометрическое распределение с параметром $p \in (0, 1)$, если её функция вероятности задаётся формулой:

$$p_\xi(k) = (1 - p)^{k-1} p, \quad k = 1, 2, \dots \quad (36.9)$$

Обозначается $\xi \sim \text{Geom}(p)$.

Матожидание и дисперсия случайной величины с геометрическим распределением равны: $\mathbb{E}(\xi) = \frac{1}{p}$, $\mathbb{D}(\xi) = \frac{1-p}{p^2}$.

Смысл геометрического распределения: ξ - число испытаний до первого успеха в схеме Бернулли с вероятностью успеха p .

D.3.5. Закон распределения абсолютно непрерывных случайных величин

Определение. Случайная величина ξ называется абсолютно непрерывной, если существует неотрицательная функция $f_\xi(x)$ такая, что для любой точки x функции распределения $F_\xi(x)$ справедливо равенство:

$$F_\xi(x) = \int_{-\infty}^x f_\xi(t) dt \quad (36.10)$$

Функция $f_\xi(x)$ называется *плотностью распределения* случайной величины ξ .

Для абсолютно непрерывной СВ в точках дифференцируемости функции распределения выполняется соотношение:

$$f_{\xi}(x) = \frac{dF_{\xi}(x)}{dx} \quad (36.11)$$

Свойства функции плотности распределения:

1. Неотрицательность: $f_{\xi}(x) \geq 0, \forall x \in \mathbb{R}$,
2. Нормировка: $\int_{-\infty}^{\infty} f_{\xi}(x) dx = 1$,
3. Вероятность попадания СВ ξ в полуинтервал $[a, b)$ вычисляется по формуле:

$$\mathbf{P}(a \leq \xi < b) = \int_a^b f_{\xi}(x) dx. \quad (36.12)$$

D.4. Числовые характеристики случайных величин

D.4.1. Моменты, математическое ожидание и дисперсия дискретных случайных величин

Следующие суммы могут быть фактически конечными, для этого достаточно, чтобы лишь конечное число значений $p(x_i)$ были отличны от нуля. Но могут и быть ряды! В этом случае предполагается, что они сходятся.

Определение. Пусть ξ – дискретная случайная величина с рядом распределения $p(x_i)$, $i = 1, 2, \dots$. Тогда

1. математическим ожиданием случайной величины ξ называется величина

$$\mathbb{E}[\xi] := \sum_{i=1}^{\infty} x_i p(x_i). \quad (37.1)$$

2. Дисперсией случайной величины ξ называется величина

$$\mathbb{D}[\xi] := \mathbb{E}[(\xi - \mathbb{E}[\xi])^2] = \sum_{i=1}^{\infty} (x_i - \mathbb{E}[\xi])^2 p(x_i). \quad (37.2)$$

3. Начальным моментом порядка k случайной величины ξ называется величина

$$M_k := \mathbb{E}[\xi^k] = \sum_{i=1}^{\infty} x_i^k p(x_i). \quad (37.3)$$

4. Центральным моментом порядка k случайной величины ξ называется величина

$$\mu_k := \mathbb{E}[(\xi - \mathbb{E}[\xi])^k] = \sum_{i=1}^{\infty} (x_i - \mathbb{E}[\xi])^k p(x_i). \quad (37.4)$$

Ясно, что $\mathbb{E}[\xi] = M_1$ и $\mathbb{D}[\xi] = \mu_2$.

Свойства математического ожидания дискретных случайных величин:

1. Если $\xi = a$ – константа, то $\mathbb{E}[a] = a$.
2. Если ξ и η – дискретные случайные величины, то $\mathbb{E}[\xi + \eta] = \mathbb{E}[\xi] + \mathbb{E}[\eta]$.
3. Если ξ – дискретная случайная величина и $c \in \mathbb{R}$, то $\mathbb{E}[c\xi] = c\mathbb{E}[\xi]$.
4. Сдвиг: $\mathbb{E}[\xi + c] = \mathbb{E}[\xi] + c$.

Таким образом, математическое ожидание является линейным функционалом.

Ниже представлены свойства дисперсии дискретных случайных величин:

1. Для любой дискретной СВ ξ : $\mathbb{D}[\xi] \geq 0$.

2. Если $\xi = a$ — константа, то $\mathbb{D}[a] = 0$.
3. Если ξ — дискретная СВ и $c \in \mathbb{R}$, то $\mathbb{D}[c\xi] = c^2\mathbb{D}[\xi]$.
4. Сдвиг: $\mathbb{D}[\xi + c] = \mathbb{D}[\xi]$.

 *Выражение дисперсии через второй момент.* Пусть ξ — дискретная случайная величина, тогда

$$\mathbb{D}[\xi] = \mathbb{E}[\xi^2] - (\mathbb{E}[\xi])^2. \quad (37.5)$$

Доказательство. \square $\mathbb{D}[\xi] = \mathbb{E}[(\xi - \mathbb{E}[\xi])^2] = \mathbb{E}[\xi^2 + (\mathbb{E}[\xi])^2 - 2 \cdot \xi \cdot \mathbb{E}[\xi]] = \mathbb{E}[\xi^2] - 2\mathbb{E}[\xi]\mathbb{E}[\xi] + (\mathbb{E}[\xi])^2 = \mathbb{E}[\xi^2] - (\mathbb{E}[\xi])^2$. ■

D.4.2. Производящие функции дискретных случайных величин

Определение. Пусть ξ — дискретная случайная величина, принимающая неотрицательные целые значения. Тогда *производящей функцией* случайной величины ξ называется функция

$$G_\xi(z) := \mathbb{E}[z^\xi] = \sum_{k=0}^{\infty} p(\xi = k)z^k, \quad |z| \leq 1 \quad (37.6)$$

Некоторые простые свойства:

1. Из нормировки вероятностей имеем

$$G_\xi(1) = \sum_{k=1}^{\infty} \mathbf{P}(\xi = k) = 1. \quad (37.7)$$

2. $G'_\xi(1) = \mathbb{E}[\xi]$.
3. Так как $\sum_k |\mathbf{P}(\xi = k)z^k| \leq \sum_k \mathbf{P}(\xi = k) = 1$, то ряд сходится абсолютно.

Найдём второй момент и дисперсию.

$$\begin{aligned} G'_\xi(z) &= \sum_k p_k k z^{k-1} \Rightarrow (z \cdot G'_\xi(z))' = \\ &= G'_\xi(z) + z \cdot G''_\xi(z) \end{aligned} \quad (37.8)$$

При $z = 1$ получим, что слева стоит второй момент:

$$M_2[\xi] = G'_\xi(1) + G''_\xi(1). \quad (37.9)$$

Откуда

$$\mathbb{D}[\xi] = G'_\xi(1) + G''_\xi(1) - (G'_\xi(1))^2. \quad (37.10)$$

Применим полученные формулы для нахождения числовых характеристик дискретных распределений:

1. Для биномиального распределения $\xi \sim \text{Bin}(n, p)$.

$$G(z) = \sum_{k=0}^n z^k C_n^k p^k q^{n-k} = \sum_{k=0}^n C_n^k (z \cdot p)^k q^{n-k} = (z \cdot p + q)^n. \quad (37.11)$$

Нормировка: $G(1) = (p + q)^n = 1$. Найдём моменты:

$$G'(z) = np(z \cdot p + q)^{n-1} |_{z=1} = np = \mathbb{E}[\xi]. \quad (37.12)$$

$$G''(1) = n(n-1)p^2 \quad (37.13)$$

$$\mathbb{D}[\xi] = G'(1) + G''(1) - (G'(1))^2 = npq. \quad (37.14)$$

2. Для распределения Пуассона $\xi \sim \text{Pois}(\lambda)$.

$$G(z) = \sum_{k=0}^{\infty} z^k \frac{\lambda^k}{k!} e^{-\lambda} = e^{-\lambda} \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(\lambda \cdot z)^k}{k!} = e^{-\lambda} e^{\lambda \cdot z} = e^{\lambda(z-1)}. \quad (37.15)$$

Откуда $G'(1) = \lambda$, $G''(1) = \lambda^2$, $\mathbb{D}[\xi] = \lambda + \lambda^2 - \lambda^2 = \lambda$.

3. Геометрическое распределение $\xi \sim \text{Geom}(p)$.

$$G(z) = \sum_{k=1}^{\infty} z^k q^{k-1} p = z \cdot p \cdot \sum_{k=0}^{\infty} (z \cdot q)^k = \frac{z \cdot p}{1 - z \cdot q}. \quad (37.16)$$

$$G'(1) = \frac{1}{p} = \mathbb{E}[\xi], \quad (37.17)$$

$$G''(1) = \frac{2q}{p^2}, \quad (37.18)$$

$$\mathbb{D}[\xi] = \frac{1}{p} + \frac{2q}{p^2} - \frac{1}{p^2} = \frac{q}{p^2}. \quad (37.19)$$

D.4.3. Числовые характеристики абсолютно непрерывных случайных величин

Определение. Пусть ξ – абсолютно непрерывная случайная величина с плотностью $f_\xi(x)$. Тогда

- математическим ожиданием случайной величины ξ называется интеграл

$$\mathbb{E}[\xi] := \int_{-\infty}^{+\infty} x \cdot f_\xi(x) dx. \quad (37.20)$$

2. Дисперсией случайной величины ξ называется интеграл

$$\mathbb{D}[\xi] := \mathbb{E}[(\xi - \mathbb{E}[\xi])^2] = \int_{-\infty}^{+\infty} (x - \mathbb{E}[\xi])^2 f_\xi(x) dx. \quad (37.21)$$

Свойства матожидания абсолютно непрерывной случайной величины:

1. Если $\xi = a$ — константа, то $\mathbb{E}[a] = a$.
2. $\mathbb{E}[\xi + \eta] = \mathbb{E}[\xi] + \mathbb{E}[\eta]$.
3. Если $c \in \mathbb{R}$, то $\mathbb{E}[c\xi] = c\mathbb{E}[\xi]$.
4. Сдвиг: $\mathbb{E}[\xi + c] = \mathbb{E}[\xi] + c$.

Таким образом, математическое ожидание является линейным функционалом. Ниже представлены свойства дисперсии абсолютно непрерывных случайных величин:

1. $\mathbb{D}[\xi] \geq 0$.
2. Если $\xi = a$ — константа, то $\mathbb{D}[a] = 0$.
3. Если $c \in \mathbb{R}$, то $\mathbb{D}[c\xi] = c^2\mathbb{D}[\xi]$.
4. Сдвиг: $\mathbb{D}[\xi + c] = \mathbb{D}[\xi]$.

 *Выражение дисперсии через второй момент.* Пусть ξ — абсолютно непрерывная случайная величина, тогда

$$\mathbb{D}[\xi] = \mathbb{E}[\xi^2] - (\mathbb{E}[\xi])^2. \quad (37.22)$$

Доказательство. \square $\mathbb{D}[\xi] = \mathbb{E}[(\xi - \mathbb{E}[\xi])^2] = \mathbb{E}[\xi^2 + (\mathbb{E}[\xi])^2 - 2 \cdot \xi \cdot \mathbb{E}[\xi]] = \mathbb{E}[\xi^2] - 2\mathbb{E}[\xi]\mathbb{E}[\xi] + (\mathbb{E}[\xi])^2 = \mathbb{E}[\xi^2] - (\mathbb{E}[\xi])^2$. ■

D.5. Основные распределения

D.5.1. Равномерное распределение

Определение. Случайная величина(абсолютно непрерывная) ξ имеет равномерное распределение на $[a, b]$, если её плотность равна

$$f_\xi(x) = \begin{cases} \frac{1}{b-a}, & x \in [a, b] \\ 0, & x \notin [a, b] \end{cases} \quad (38.1)$$

обозначается $\xi \sim U(a, b)$. Очевидно, что $\int_{-\infty}^{+\infty} f_\xi(x)dx = 1$. Функция распределения:

$$F_\xi(x) = \begin{cases} 0, & x < a \\ \frac{x-a}{b-a}, & x \in [a, b] \\ 1, & x > b. \end{cases} \quad (38.2)$$

Числовые характеристики:

$$\mathbb{E}[\xi] = \frac{a+b}{2}, \quad (38.3)$$

$$\mathbb{E}[\xi^2] = \frac{a^2 + ab + b^2}{3}, \quad (38.4)$$

$$\mathbb{D}[\xi] = \frac{(b-a)^2}{12}. \quad (38.5)$$

D.5.2. Показательное распределение

Определение. Случайная величина(абсолютно непрерывная) ξ имеет показательное распределение с параметром $\lambda > 0$, если её плотность равна

$$f_\xi(x) = \begin{cases} \lambda e^{-\lambda x}, & x \geq 0 \\ 0, & x < 0 \end{cases} \quad (38.6)$$

обозначается $\xi \sim \text{Exp}(\lambda)$. Проверим

$$\int_{-\infty}^{+\infty} f_\xi(x)dx = \lambda \int_0^{+\infty} e^{-\lambda x} dx = -e^{-\lambda x} \Big|_0^{+\infty} = 1. \quad (38.7)$$

Функция распределения:

$$F_\xi(x) = 1 - e^{-\lambda x}, \quad x \geq 0 \quad (38.8)$$

(иначе 0). Числовые характеристики:

$$\mathbb{E}[\xi] = \frac{1}{\lambda} \quad (38.9)$$

$$\mathbb{D}[\xi] = \frac{1}{\lambda^2} \quad (38.10)$$

Свойство незапоминаемости:

$$\mathbf{P}(\xi > s + t \mid \xi > s) = \mathbf{P}(\xi > t), \quad \forall s, t \geq 0. \quad (38.11)$$

D.5.3. Простейший поток событий

Определение. Поток событий — последовательность моментов времени, в которые происходят некоторые однотипные события.

Определение. Поток событий называется простейшим(пуассоновским), если выполнено:

1. Стационарность: вероятность наступления k событий на отрезке длины t зависит только от k и t .
2. Ординарность: вероятность наступления более одного события за бесконечно малый промежуток dt есть $o(dt)$.
3. Отсутствие последействия: число событий на непересекающихся интервалах независимо

Отсюда следует, что число событий $N(t)$, наступивших за время t , распределено по закону Пуассона с параметром λt :

$$\mathbf{P}(N(t) = k) = \frac{(\lambda t)^k}{k!} e^{-\lambda t} \quad (38.12)$$

D.5.4. Нормальное распределение

Определение. Нормальное распределение задается функцией плотности

$$f_\xi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi} \cdot \sigma} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}} \quad (38.13)$$

Функция распределения $\xi \sim N(\mu, \sigma)$

$$F_\xi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi} \cdot \sigma} \int_{-\infty}^x e^{-\frac{(t-\mu)^2}{2\sigma^2}} dt \quad (38.14)$$

Можно проверить, что

1. Плотность определена корректно:

$$\frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-\frac{(t-\mu)^2}{2\sigma^2}} dt = 1 \quad (38.15)$$

2. $\mathbb{E}[\xi] = \mu$

3. $\mathbb{D}[\xi] = \sigma^2$.

Определим для стандартного нормального распределения $\xi \sim N(0, 1)$

$$\Phi(x) = F_\xi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^x e^{-\frac{t^2}{2}} dt \quad (38.16)$$

Напомним, что функция Лапласа $\Phi_0(x)$ определяется как

$$\Phi_0(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_0^x e^{-\frac{t^2}{2}} dt \quad (38.17)$$

Тогда

$$\Phi(x) = \frac{1}{2} + \Phi_0(x) \quad (38.18)$$

$$\begin{aligned} F_\xi(x) &= \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^x e^{-\frac{t^2}{2}} dt = \left[\frac{t - \mu}{\sigma} = z \right] = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^{\frac{x-\mu}{\sigma}} e^{-\frac{z^2}{2}} dz = \\ &= \Phi\left(\frac{x - \mu}{\sigma}\right) = \frac{1}{2} + \Phi_0\left(\frac{x - \mu}{\sigma}\right) \end{aligned} \quad (38.19)$$

Вероятность попадания в заданный интервал. Пусть $\xi \sim N(\mu, \sigma)$. Найдём $\mathbf{P}(\xi \in [\alpha, \beta])$

$$\begin{aligned} \mathbf{P}(\xi \in [\alpha, \beta]) &= F_\xi(\beta) - F_\xi(\alpha) = \Phi\left(\frac{\beta - \mu}{\sigma}\right) - \Phi\left(\frac{\alpha - \mu}{\sigma}\right) = \\ &= \Phi_0\left(\frac{\beta - \mu}{\sigma}\right) - \Phi_0\left(\frac{\alpha - \mu}{\sigma}\right) \end{aligned} \quad (38.20)$$

Для симметричного интервала получим:

$$P(|\xi - \mu| \leq \delta) = 2\Phi_0\left(\frac{\delta}{\sigma}\right) \quad (38.21)$$

Правило 3-х сигм. Пусть $\delta = 3\sigma$

$$P(|\sigma - \mu| < 3\sigma) = 2\Phi_0(3) \approx 0.9974 \quad (38.22)$$

D.5.5. Центрированная, нормированная случайная величина. Распределение линейной функции случайного аргумента

Определение. Пусть случайная величина ξ имеет конечные матожидание m и дисперсию σ^2 . Тогда

1. случайная величина $\xi_0 := \xi - m$ называется центрированной. $\mathbb{E}[\xi_0] = 0$.
2. случайная величина $\bar{\xi} = \frac{\xi - m}{\sigma}$ называется нормированной. Имеет $\mathbb{E}[\bar{\xi}] = 0$ и $\mathbb{D}[\bar{\xi}] = 1$.

Стандартный нормальный закон $N(0, 1)$ — нормальное распределение с $\mu = 0$ и $\sigma = 1$.

Пусть X — случайная величина с известным распределением, хотим найти $Y = aX + b$ для $a, b \in \mathbb{R}$.

1. Если $a > 0$, то функция распределения для Y есть

$$F_Y(y) = \mathbf{P}(Y < y) = \mathbf{P}(aX + b < y) = F_X\left(\frac{y - b}{a}\right) \quad (38.23)$$

2. Если $a < 0$, то

$$F_Y(y) = \mathbf{P}\left(X \geq \frac{y - b}{a}\right) = 1 - F_X\left(\frac{y - b}{a}\right) + \mathbf{P}\left(X = \frac{y - b}{a}\right) \quad (38.24)$$

Для абсолютно непрерывной СВ это можно продифференцировать и найти плотность $\forall a \neq 0$:

$$f_Y(y) = \frac{1}{|a|} f_X\left(\frac{y - b}{a}\right). \quad (38.25)$$

D.6. Системы случайных величин

D.6.1. Функция распределения двух переменных

Для двух случайных величин совместная функция распределения.

$$F_{\xi,\eta}(x, y) = P(\xi < x, \eta < y) = P(\{\xi < x\} \cap \{\eta < y\}) \quad (39.1)$$

Свойства двумерной функции распределения

1. $0 \leq F_{\xi,\eta}(x, y) \leq 1, \forall x, y \in \mathbb{R}$

2. Значения на бесконечности

$$F_{\xi,\eta}(+\infty, +\infty) = P(\Omega) = 1 \quad (39.2)$$

$$F_{\xi,\eta}(-\infty, -\infty) = P(\emptyset) = 0 \quad (39.3)$$

3. Формулы согласованности

$$F_{\xi,\eta}(x, +\infty) = P(\xi < x) = F_{\xi}(x) \quad (39.4)$$

$$F_{\xi,\eta}(+\infty, y) = P(\eta < y) = F_{\eta}(y) \quad (39.5)$$

4. Монотонное возрастание.

$$F_{\xi,\eta}(x, y) \nearrow \text{на } \mathbb{R}^2 \quad (39.6)$$

5. Вероятность попадания в прямоугольную область. Если

$$\begin{cases} x_1 \leq x \leq x_2 \\ y_1 \leq y \leq y_2 \end{cases} \quad (39.7)$$

то вероятность попадания в данный прямоугольник

$$\begin{aligned} P(x_1 \leq \xi \leq x_2, y_1 \leq \eta \leq y_2) &= \\ &= F(x_2, y_2) - F(x_1, y_2) - F(x_2, y_1) + F(x_1, y_1) \end{aligned} \quad (39.8)$$

D.6.2. Система дискретных случайных величин и её числовые характеристики

Можно построить двумерную таблицу, аналогичную ряду распределения.

ξ^η	x_1	x_2	...	x_n
y_1	p_{11}	p_{12}	...	p_{1n}
y_2	p_{21}	p_{22}	...	p_{2n}
\vdots
y_m	p_{m1}	p_{m2}	...	p_{mn}

Условия:

1. $p_{ij} \geq 0$
2. $\sum_{i,j} p_{i,j} = 1$

Имеют место так называемые маргинальные распределения:

$$\mathbf{P}(X = x_i) = \sum_{j=1}^m p_{ij} \quad (39.9)$$

$$\mathbf{P}(Y = y_j) = \sum_{i=1}^n p_{ij} \quad (39.10)$$

Математическое ожидание в системе дискретных СВ определяется как

$$\mathbb{E}[X] := \sum_{i=1}^n x_i \mathbf{P}(X = x_i) = \sum_{i,j} x_i p_{ij} \quad (39.11)$$

$$\mathbb{E}[Y] := \sum_{j=1}^m y_j \mathbf{P}(Y = y_j) = \sum_{i,j} y_j p_{ij} \quad (39.12)$$

Дисперсии:

$$\begin{aligned} \mathbb{D}[X] &:= \mathbb{E}[X^2] - (\mathbb{E}[X])^2 \\ \mathbb{D}[Y] &:= \mathbb{E}[Y^2] - (\mathbb{E}[Y])^2 \end{aligned} \quad (39.13)$$

Определение. Ковариацией(корреляционным моментом) системы из двух дискретных случайных величин называется величина

$$K_{XY} := \mathbb{E}[(X - \mathbb{E}[X])(Y - \mathbb{E}[Y])] = \sum_{i,j} (x_i - \mathbb{E}[x])(y_j - \mathbb{E}[y])p_{ij}. \quad (39.14)$$

Можно получить её более простое представление:

$$K_{XY} = \mathbb{E}[XY] - \mathbb{E}[X]\mathbb{E}[Y], \quad (39.15)$$

где $E[XY] = \sum_{i,j} x_i y_j p_{ij}$.

Определение. Коэффициентом корреляции двух дискретных СВ X и Y называется величина

$$\rho_{XY} := \frac{K_{XY}}{\sqrt{\mathbb{D}[X] \cdot \mathbb{D}[Y]}} \quad (39.16)$$

можете воспринимать его как косинус угла между векторами.

D.6.3. Система непрерывных случайных величин и её числовые характеристики

Определение. Система случайных величин называется непрерывной, если её функцию распределения можно представить в виде

$$F(x, y) = \int_{-\infty}^x \int_{-\infty}^y f(t, \tau) dt d\tau \quad (39.17)$$

где неотрицательная кусочно-непрерывная функция f называется совместной плотностью.

Свойства плотности $f(x, y)$:

1. $f(x, y) \geq 0 \quad \forall x, y \in \mathbb{R}$.
2. Во всех точках непрерывности f :

$$f(x, y) = \frac{\partial^2 F(x, y)}{\partial x \partial y} \quad (39.18)$$

3. Вероятность попадания в прямоугольник $D = \{(x, y) : x_1 \leq x \leq x_2, y_1 \leq y \leq y_2\}$:

$$\mathbf{P}(D) = \int_{x_1}^{x_2} \left(\int_{y_1}^{y_2} f(x, y) dy \right) dx \quad (39.19)$$

4. Для всякой квадрируемой области D

$$\mathbf{P}(D) = \iint_D f(x, y) dx dy \quad (39.20)$$

5. Условие нормировки:

$$\int_{-\infty}^{+\infty} \int_{-\infty}^{+\infty} f(x, y) dx dy = 1. \quad (39.21)$$

6. Частные плотности:

$$f_X(x) = \int_{\mathbb{R}} f(x, y) dy \quad (39.22)$$

$$f_Y(y) = \int_{\mathbb{R}} f(x, y) dx. \quad (39.23)$$

Числовые характеристики. Математическое ожидание:

$$\mathbb{E}[X] := \int_{\mathbb{R}} x f_X(x) dx = \iint_{\mathbb{R}^2} x f(x, y) dx dy \quad (39.24)$$

$$\mathbb{E}[Y] := \int_{\mathbb{R}} y f_Y(y) dy = \iint_{\mathbb{R}^2} y f(x, y) dx dy \quad (39.25)$$

Дисперсия:

$$\mathbb{D}[X] := \int_{\mathbb{R}} (x - \mathbb{E}[x])^2 f_X(x) dx = \mathbb{E}[X^2] - (\mathbb{E}[x])^2, \quad (39.26)$$

аналогично для Y .

Определение. Ковариацией двух непрерывных случайных величин называется интеграл

$$\text{Cov}(X, Y) = \iint_{\mathbb{R}^2} (x - \mathbb{E}[X])(y - \mathbb{E}[Y]) f(x, y) dx dy \quad (39.27)$$

Отсюда можно получить, что

$$K_{XY} = \mathbb{E}[XY] - \mathbb{E}[X]\mathbb{E}[Y], \quad (39.28)$$

где $\mathbb{E}[XY] = \iint_{\mathbb{R}^2} xy f(x, y) dx dy$.

Определение. Коэффициентом корреляции двух непрерывных СВ X и Y называется величина

$$\rho_{XY} := \frac{\text{Cov}(X, Y)}{\sqrt{\mathbb{D}[X] \cdot \mathbb{D}[Y]}}. \quad (39.29)$$

Определение. Математическим ожиданием случайного вектора $\mathbf{X} = (X_1, \dots, X_n)$ называется величина

$$\mathbb{E}[\mathbf{X}] := (\mathbb{E}[X_1], \dots, \mathbb{E}[X_n])^T \quad (39.30)$$

Определение. Ковариационной матрицей Σ двух случайных векторов называется величина

$$\boldsymbol{\sigma} = \text{Cov}(\mathbf{X}, \mathbf{Y}) := \mathbb{E}[(\mathbf{X} - \mathbb{E}[\mathbf{X}])(\mathbf{Y} - \mathbb{E}[\mathbf{Y}])^T] \quad (39.31)$$

1. Матрица ковариаций симметрична: $\Sigma = \Sigma^T$
2. Матрица ковариаций положительно полуопределенна: $\mathbf{t}^T \Sigma \mathbf{t} \geq 0, \forall \mathbf{t} \in \mathbb{R}^n$.

D.6.4. Многомерное нормальное распределение

Определение. Случайный вектор \mathbf{X} имеет многомерное нормальное распределение, если его характеристическая функция имеет вид

$$\phi_{\mathbf{X}}(\mathbf{t}) = \exp\left(it\boldsymbol{\mu} - \frac{1}{2}\mathbf{t}^T \Sigma \mathbf{t}\right), \quad \mathbf{t} \in \mathbb{R}^n. \quad (39.32)$$

D.6.5. Условия независимости случайных величин

Определение. Случайные величины ξ, η называются независимыми, если события $A = \{\xi < x\}$ и $B = \{\eta < y\}$ независимы $\forall x, y \in \mathbb{R}$.

Из определения независимости СВ ясно, что

$$P(A) \cdot P(B) = P(A \cap B) \quad (39.33)$$

Условие независимости двух случайных величин.

$$F_{\xi, \eta}(x, y) = F_{\xi}(x) \cdot F_{\eta}(y) \Leftrightarrow \xi, \eta \text{ независимы} \quad (39.34)$$

Для непрерывных СВ с плотностями f_X, f_Y и $f(x, y)$ они независимы тогда и только тогда, когда

$$f(x, y) = f_X(x)f_Y(y), \quad (39.35)$$

1. Из независимости следует некоррелированность.
2. Обратное неверно, например $X \sim N(0, 1)$ и $Y = X^2$.
3. Для совместно нормальных СВ они эквивалентны.

D.6.6. Свойства математического ожидания и дисперсии в системах СВ

1. $\mathbb{E}[aX + bY + c] = a\mathbb{E}[x] + b\mathbb{E}[y] + c$
2. Если X и Y независимы, то

$$\mathbb{E}[XY] = \mathbb{E}[X]\mathbb{E}[Y] \quad (39.36)$$

3. $\mathbb{D}[X \pm Y] = \mathbb{D}[X] + \mathbb{D}[Y] \pm 2 \cdot K_{XY}$ В частности, если X и Y независимы, то $K_{XY} = 0$.

$$\mathbb{D}[X + Y] = \mathbb{D}[X] + \mathbb{D}[Y] \quad (39.37)$$

D.6.7. Свойства ковариации и корреляции

1. Симметричность ковариации: $K_{XY} = K_{YX}$
2. Билинейность ковариации:

$$K_{aX+bY, Z} = aK_{X, Z} + bK_{Y, Z} \quad (39.38)$$

из симметричности следует линейность по второму.

3. Ковариация с константой: $K_{X, c} = c$
4. Ковариация независимых СВ X и Y равна нулю: $K_{XY} = 0$. Обратное вообще говоря неверно.
5. Неравенство Коши-Буняковского для ковариации:

$$(K_{XY})^2 \leq \mathbb{D}[X]\mathbb{D}[Y] \quad (39.39)$$

Доказательство. \square Пусть $Z := X + tY$. Рассмотрим дисперсию как многочлен из $\mathbb{R}[t]$.

$$\mathbb{D}[X + tY] = \mathbb{D}[x] + 2tK_{XY} + t^2\mathbb{D}[Y] \geq 0 \quad (39.40)$$

следовательно дискриминант этого многочлена неположителен:

$$4K_{XY}^2 - 4\mathbb{D}[X]\mathbb{D}[Y] \leq 0 \quad (39.41)$$

■

6. Ограниченнность корреляции. Из неравенства К-Б следует, что

$$-1 \leq \rho_{XY} \leq 1 \quad (39.42)$$

7. симметричность: $\rho_{XY} = \rho_{YX}$.
8. линейное преобразование:

$$\rho_{aX+b, cY+d} = \text{sign}(a \cdot c) \cdot \rho_{XY} \quad (39.43)$$

D.7. Закон больших чисел и центральная предельная теорема

D.7.1. Неравенства Маркова и Чебышёва

Теорема(Неравенство Маркова). Пусть X – неотрицательная случайная величина.

Тогда $\forall a > 0$:

$$\mathbf{P}(X \geq a) \leq \frac{\mathbb{E}[x]}{a} \quad (40.1)$$

Доказательство. \square Проведем для абсолютно непрерывной СВ. Так как $X \geq 0$, то

$$\mathbb{E}[X] = \int_0^{+\infty} xf(x)dx = \int_0^a xf(x)dx + \int_a^{+\infty} xf(x)dx \quad (40.2)$$

Отсюда

$$\mathbb{E}[X] \geq \int_a^{+\infty} xf(x)dx \geq \int_a^{+\infty} af(x)dx = a \cdot \mathbf{P}(X \geq a) \blacksquare \quad (40.3)$$

Теорема(Неравенство Чебышёва). Пусть X – случайная величина с конечными математическим ожиданием и дисперсией. Тогда $\forall \varepsilon > 0$:

$$\mathbf{P}(|X - \mathbb{E}[X]| \geq \varepsilon) \leq \frac{\mathbb{D}[X]}{\varepsilon^2} \quad (40.4)$$

Доказательство. \square Рассмотрим $Y := (X - \mathbb{E}[X])^2$. $\mathbb{E}[Y] = \mathbb{D}[X]$. Применим к Y неравенство Маркова для $a = \varepsilon^2$.

$$\mathbf{P}((X - \mathbb{E}[X])^2 > \varepsilon^2) \leq \frac{\mathbb{D}[X]}{\varepsilon^2} \quad (40.5)$$

■

Определение. Последовательность СВ $\{X_n\}$ сходится по вероятности к X , если $\forall \varepsilon > 0$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \mathbf{P}(|X_n - X| \geq \varepsilon) = 0. \quad (40.6)$$

Обозначается $X_n \xrightarrow{\mathbf{P}} X$.

D.7.2. Закон больших чисел

ЗБЧ в форме Чебышёва. Пусть X_1, \dots, X_n — последовательность некоррелированных СВ, с конечной дисперсией ограниченной одной константой $\mathbb{D}[X_i] \leq C$. Тогда $\forall \varepsilon > 0$:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \mathbf{P} \left(\left| \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i - \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbb{E}[X_i] \right| \geq \varepsilon \right) \geq \varepsilon \quad (40.7)$$

Доказательство \square Пусть $\overline{X_n} = \frac{1}{n} \sum X_i$,

$$\mathbb{E}[\overline{X_n}] = \frac{1}{n} \sum \mathbb{E}[X_i] \quad (40.8)$$

$$\mathbb{D}[\overline{X_n}] = \frac{1}{n^2} \sum \mathbb{D}[X_i] \leq \frac{1}{n^2} \cdot nC = \frac{C}{n}. \quad (40.9)$$

Согласно неравенству Чебышёва,

$$\mathbf{P} \left(\left| \overline{X_n} - \mathbb{E}(\overline{X_n}) \right| \geq \varepsilon \right) \leq \frac{\mathbb{D}[\overline{X_n}]}{\varepsilon^2} \leq \frac{C}{\varepsilon^2 n} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0 \quad (40.10)$$

■

D.7.3. Центральная предельная теорема

Пусть X_1, \dots, X_n, \dots — последовательность независимых одинаково распределённых СВ с конечным $\mu = \mathbb{E}[X_i]$ и $\sigma^2 = \mathbb{D}[X_i] > 0$. Пусть $S_n := \sum_{i=1}^n X_i$. Тогда

$$\frac{S_n - n \cdot \mu}{\sigma \sqrt{n}} \longrightarrow Z \sim N(0, 1). \quad (40.11)$$

E. Алгоритмы и структуры данных && программирование

E.1. Основные понятия

Алгоритм — точное или формализованное описание вычислительного процесса, ведущее от входных данных к искомому результату.

Структуры данных — множество элементов данных и связи между ними.

Физические данные существуют в памяти машины, а теоретические нет.

Элементарные данные не могут быть разделены на более мелкие части. Если же данные могут быть разделены на логически более мелкие части, то они называются *сложными*.

E.1.1. Анализ сложности и эффективности алгоритмов

Должны быть некие критерии *хорошего алгоритма*.

Два основных критерия, используемых на практике:

1. Быстродействие;
2. Объём потребляемой памяти.

Прямое измерение времени работы программной реализации измеряет далеко не только быстродействие алгоритма. На время выполнения влияют так же способ реализации, умения программиста, среда разработки и мощность компьютера.

Измерения скорости и памяти носят теоретический характер.

$T(n)$ — функция теоретического времени работы алгоритма.

$V(n)$ — функция теоретической пространственной сложности алгоритма.

Получить точную формулу нельзя, можно только получить скорость и порядок скорости изменения времени выполнения.

E.2. Асимптотические оценки функций

Далее при анализе алгоритмов будем полагать, что все функции асимптотически положительны.

- Функция $f(n)$ принадлежит О-большому от функции $g(n)$, если существуют такие положительные константы C и N , что для всех $n > N$ функция $f(n)$ ограничена сверху функцией $g(n)$, умноженной на константу C .

$$f(n) = O(g(n)) \Leftrightarrow \exists N, C > 0 : \forall n > N : f(n) \leq C \cdot g(n) \quad (42.1)$$

- Функция $f(n)$ принадлежит Омега-большому от функции $g(n)$, если существуют такие положительные константы C и N , что для всех $n > N$ функция $f(n)$ ограничена снизу функцией $g(n)$, умноженной на константу C .

$$f(n) = \Omega(g(n)) \Leftrightarrow \exists N, C > 0 : \forall n > N : f(n) \geq C \cdot g(n) \quad (42.2)$$

- Функция $f(n)$ принадлежит тетта-большому от функции $g(n)$, если существуют такие положительные константы C_1 , C_2 и N , что для всех $n > N$ функция $f(n)$ ограничена сверху и снизу функцией $g(n)$, умноженной на константы C_1 и C_2 соответственно.

$$\begin{aligned} f(n) = \Theta(g(n)) \Leftrightarrow \exists N, C_1, C_2 > 0 : \forall n > N : \\ C_1 \cdot g(n) \leq f(n) \leq C_2 \cdot g(n) \end{aligned} \quad (42.3)$$

- Функция $f(n)$ принадлежит о-малому от функции $g(n)$, если предел отношения f и g равен нулю при неограниченном возрастании n .

$$f(n) = o(g(n)) \Leftrightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{f(n)}{g(n)} = 0 \quad (42.4)$$

- Функция $f(n)$ принадлежит омега-малому от функции $g(n)$, если предел отношения g и f равен нулю при неограниченном возрастании n .

$$f(n) = \omega(g(n)) \Leftrightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{g(n)}{f(n)} = 0 \quad (42.5)$$

E.2.1. Свойства сравнений функций

- Транзитивность.

- из $f(n) = \Theta(g(n))$ и $g(n) = \Theta(h(n))$ следует $f(n) = \Theta(h(n))$
- из $f(n) = O(g(n))$ и $g(n) = O(h(n))$ следует $f(n) = O(h(n))$
- из $f(n) = \Omega(g(n))$ и $g(n) = \Omega(h(n))$ следует $f(n) = \Omega(h(n))$

- из $f(n) = o(g(n))$ и $g(n) = o(h(n))$ следует $f(n) = o(h(n))$
- из $f(n) = \omega(g(n))$ и $g(n) = \omega(h(n))$ следует $f(n) = \omega(h(n))$

2. Рефлексивность.

- $f(n) = \Theta(f(n))$
- $f(n) = O(f(n))$
- $f(n) = \Omega(f(n))$

3. Симметричность.

- $f(n) = \Theta(g(n)) \Rightarrow g(n) = \Theta(f(n))$

4. Перестановочная симметрия.

- $f(n) = O(g(n)) \Leftrightarrow g(n) = \Omega(f(n))$
- $f(n) = o(g(n)) \Leftrightarrow g(n) = \omega(f(n))$

E.3. Бинарный поиск

Классический бинарный поиск это алгоритм поиска на отсортированном массиве со значениями в диапазоне $[a; b]$. Ниже приведён псевдокод для этого алгоритма.

```
fun binary_search(array, x):
    n = array.len()
    l, r = 0, n-1
    while l <= r:
        mid = (l + r) / 2
        if arr[mid] == x:
            return mid
        if array[mid] < x:
            l = mid + 1
        else:
            r = mid - 1
    return -1
```

Временная сложность данного алгоритма равна $O(\log n)$.

E.3.1. Вариант с поиском границ

- Если требуется найти **левую** границу, когда требуемое условие выполняется, то можно использовать такой алгоритм.

```
fun left_binary_search(l, r, check, checkparams):
    while l < r:
        mid = (l + r)/2
        if check(mid, checkparams):
            r = mid
        else:
            l = mid + 1
    return l
```

- Если требуется найти **правую** границу, когда требуемое условие выполняется, то можно использовать такой алгоритм.

```
fun right_binary_search(l, r, check, checkparams):
    while l < r:
        mid = (l + r + 1)/2
        if check(mid, checkparams):
            l = mid
        else:
            r = mid - 1
    return l
```

На практике, лучше проверять реализацию бинпоиска на 2-х числах!

E.4. Динамическое программирование

Динамическое программирование(ДП) позволяет решать задачи, комбинируя решения вспомогательных задач.

Два варианта задач для решения методом динамического программирования:

- подсчёт количества способов;
- оптимизация(максимум или минимум).

Этапы решения задачи методом ДП.

1. Описание структуры оптимального решения;
2. Рекурентное соотношение для значения, соответствующего оптимальному решению(включая базу динамики);
3. Вычисление значения, соответствующего оптимальному решению методом восходящего анализа.
4. Составление оптимального решения, полученного на предыдущих этапах.

E.4.1. Простые примеры ДП

E.4.1.1. Ступеньки

За один шаг можно подняться на одну или две ступеньки. За посещение каждой из ступенек дают a_i рублей. Необходимо найти максимальную сумму за подъём на вершину лестницы из n ступенек.

Решение: Пусть $dp[i]$ - максимальная сумма за подъём на i -ю ступеньку. Тогда

$$dp[i] = a[i] + \max(dp[i-1], dp[i-2]) \quad (44.1)$$

База динамики. $dp[0] = 0$, $dp[1] = a[1]$. Ответ: $dp[n]$ ■.

Полученное решение имеет временную и пространственную сложность $\Theta(n)$. Пример таблицы для данной задачи(0 добавлен в качестве нулевого элемента).

$a[i]$	0	10	-5	-20	-10	20	30	-10	10
$dp[i]$	0	10	5	-10	-5	15	45	35	55

E.4.1.2. Ступеньки с сертификатом

За один шаг можно подняться на одну или две ступеньки. За посещение каждой из ступенек дают a_i рублей. Необходимо найти максимальную сумму за подъём на вершину лестницы из n ступенек. Вывести номера ступенек, по которым мы шагали.

Решение: Пусть $dp[i]$ - максимальная сумма за подъём на i -ю ступеньку. Выделим массив $prev[n]$, в i -том элементе которого будем хранить номер ступеньки, с которой мы попали на i -ю ступеньку. Тогда

$$dp[i] = a[i] + \max(dp[i-1], dp[i-2]) \quad (44.2)$$

$$prev[i] = \underset{i}{\operatorname{argmax}}(dp[i-1], dp[i-2]) \quad (44.3)$$

База динамики. $dp[0] = 0$, $dp[1] = a[1]$ и теперь добавляется $prev[1] = 0$. Ответ: $dp[n]$ ■.

Пример таблицы для данной задачи:

$a[i]$	0	10	-5	-20	-10	20	30	-10	10
$dp[i]$	0	10	5	-10	-5	15	45	35	55
$prev[i]$	0	0	1	1	2	4	5	6	6

E.4.1.3. Наибольшая возрастающая подпоследовательность

Задача: найти длину наибольшей возрастающей подпоследовательности в массиве a .

- *подпоследовательность* — подпоследовательность, полученная вычёркиванием некоторых элементов из исходной(необязательно подряд идущих);
- *возрастающая* — $\forall i \in \overline{1..n} : a_{i+1} > a_i$.
- *наибольшая* — максимальная по длине среди всех подходящих подпоследовательностей.

Решение. Пусть $dp[i]$ - длина наибольшей возрастающей подпоследовательности, заканчивающейся на i -ом элементе. Будем для очередного элемента $a[i]$ запускать внутренний цикл на отрезке от 0 до $i-1$ и проверять, можно ли продлить возрастающую подпоследовательность элементом $a[i]$. Если да, то берём максимум из всех подходящих $dp[j]$ ($j < i$). Если нет, то записываем $prev[i] = -1$ и $a[i] = 1$. Ответ на задачу: $\max(dp[i])$.

К сожалению, временная сложность этого решения $\Theta(n^2)$. Пример таблицы ниже. Жёлтым выделены индексы НВП, зелёным максимум динамики(ответ), а красным те элементы, у которых нет предшественников.

индекс	0	1	2	3	4	5	6
$a[i]$	4	10	5	12	3	24	7
$dp[i]$	1	2	2	3	1	4	3
$prev[i]$	-1	0	0	1	-1	3	2

Приведём решение за $O(n \log n)$.

E.4.1.4. Покупка билетов

В очереди за билетами стоит n людей. i – й человек может купить себе билет за A_i секунд. Себе и следующему за B_i секунд. Себе, следующему и ещё одному за ним за C_i секунд. Найти минимальное время, за которое все люди будут с билетами.

Решение. Пусть $dp[i]$ - минимальное время обивечивания первых i людей. Тогда рекуррентное соотношение будет иметь вид:

$$\begin{aligned} dp[i] &= \max(dp[i-1] + A_i, \\ &\quad dp[i-2] + B_i, \\ &\quad dp[i-3] + C_i) \end{aligned} \tag{44.4}$$

В качестве базы динамики запишем 3 виртуальных человека с бесконечным временем покупки, чтобы начинать использовать рекурренту с $n = 1$ и определим для них динамику, равную 0. Сложность решения по времени равна $\Theta(n)$.

Пример таблицы для этой задачи ниже.

№	A_i	B_i	C_i	$dp[i]$
-2	∞	∞	∞	0
-1	∞	∞	∞	0
0	∞	∞	∞	0
1	5	10	15	5
2	2	10	15	7
3	5	5	5	12
4	20	20	1	12
5	20	1	1	12

E.4.1.5. Представление числа минимальной последовательностью операций

Дано целое число $N \leq 10^4$. Представить его в виде арифметического выражения *минимальной длины*, в котором используются только операции сложения, умножения и скобки, а все числа не превосходят K .

Решение. Пусть $dp[i]$ - минимальная длина арифметического выражения для числа i .

E.4.2. Двумерное динамическое программирование

E.4.2.1. Наибольшая общая подпоследовательность

Наибольшая общая подпоследовательность (НОП) двух последовательностей - это максимальная по длине подпоследовательность, которую можно получить вычеркиванием некоторых элементов из первой и из второй последовательности.

Задача. Даны две последовательности a и b . Найти НОП для этих последовательностей.

Решение. Пусть $dp[i][j]$ - длина НОП для первых i элементов последовательности a и первых j элементов последовательности b . Обозначим $n = |a|$, $m = |b|$.

1. Если $a[i] = b[j]$, то $dp[i][j] = dp[i - 1][j - 1] + 1$ (если элементы совпали, то мы берём данный элемент в НОП).
2. Иначе, как минимум один из элементов $a[i]$ или $b[j]$ не входит в НОП. Тогда $dp[i][j] = \max(dp[i - 1][j], dp[i][j - 1])$.

Итак,

$$dp[i][j] = \begin{cases} 0, & \text{если } i \cdot j = 0 \\ dp[i - 1][j - 1] + 1, & \text{если } a[i] = b[j] \\ \max(dp[i - 1][j], dp[i][j - 1]), & \text{если } a[i] \neq b[j] \end{cases} \quad (44.5)$$

Длина НОП равна $dp[n - 1][m - 1]$. Для восстановления ответа поднимаемся по таблице dp в обратном порядке по следующему алгоритму:

1. Если $a[i] = b[j]$, то добавляем этот элемент в НОП и переходим к $dp[i - 1][j - 1]$.
2. Иначе, переходим к $dp[i - 1][j]$ или $dp[i][j - 1]$, а точнее к тому из них, который имеет большее значение.

Сложность нахождения длины НОП по времени равна $\Theta(n \cdot m)$. Для восстановления ответа потребуется ещё $O(n + m)$ времени.

E.4.2.2. Расстояние Левенштейна

Расстояние Левенштейна (редакционное расстояние) между двумя строками - это минимальное количество операций (вставка, удаление, замена), необходимых для преобразования одной строки в другую.

Задача. Даны две строки s и t . Найти расстояние Левенштейна между ними.

Решение. Пусть $dp[i][j]$ - расстояние Левенштейна между первыми i символами строки s и первыми j символами строки t . Обозначим $n = |s|$, $m = |t|$.

1. Если $s[i] = t[j]$, то $dp[i][j] = dp[i - 1][j - 1]$.
2. Иначе, $dp[i][j] = \min(dp[i - 1][j] + 1, dp[i][j - 1] + 1, dp[i - 1][j - 1] + 1)$.

Итак, расстояние Левенштейна между строками s и t равно $dp[n - 1][m - 1]$. Этот алгоритм работает за $\Theta(n \cdot m)$.

F. Анализ данных