

МНОГОМЕРНЫЙ АНАЛИЗ, ИНТЕГРАЛЫ И РЯДЫ. БИЛЕТЫ.

Над файлом работали:

Баранников Андрей Б01-001
Дорин Даниил Б01-001
Киселев Никита Б01-001
Овсянников Михаил Б01-001
Панферов Иван Б01-001
Филиппенко Павел Б01-001
Курневич Станислав Б01-002
Лепарский Роман Б01-003
Артамонов Кирилл Б01-005
Белов Владислав Б01-005
Паншин Артём Б01-005
Глаз Роман Б01-007
Дурнов Алексей Б01-007
Талашкевич Даниил Б01-009
Фатыхов Тимур Б01-009

Содержание

1	Билет 1	4
1.1	Предел последовательности точек в n -мерном евклидовом пространстве. . .	4
1.2	Теорема Больцано–Вейерштрасса и критерий Коши сходимости последовательности.	5
1.3	Внутренние, предельные, изолированные точки множества.	8
1.4	Открытые и замкнутые множества, их свойства.	8
1.5	Внутренность, замыкание и граница множества.	11
1.6	Компакты.	11
1.7	Метрическое пространство.	11
1.8	Компакты в метрическом пространстве и описание компактов в n -мерном евклидовом пространстве.	12
2	Билет 2	14
2.1	Предел числовой функции нескольких переменных.	14
2.2	Предел функции по множеству.	15
2.3	Непрерывность функции нескольких переменных в точке и по множеству. .	16
2.4	Свойства функций, непрерывных на компакте: ограниченность, достижение точных нижней и верхней граней, равномерная непрерывность (теорема Кантора).	17
2.5	Теорема о промежуточных значениях функции, непрерывной в области. . .	19
3	Билет 3	20
3.1	Частные производные функции нескольких переменных.	20
3.2	Дифференцируемость функции в точке	20
3.3	Достаточные условия дифференцируемости функции в точке	22
3.4	Дифференцируемость сложной функции	24
3.5	Дифференциал. Инвариантность формы дифференциала относительно замены переменных.	25
3.6	Производная по направлению и градиент, их связь и геометрический смысл. .	26
3.7	Необходимые условия дифференцируемости	27
4	Билет 4	29
4.1	Частные производные высших порядков.	29
4.2	Независимость смешанной частной производной от порядка дифференцирования.	29
4.3	Дифференциалы высших порядков. Отсутствие инвариантности их формы. .	31
4.4	Формула Тейлора для функций нескольких переменных.	32
5	Билет 5	33
5.1	Необходимые определения и предложения билета.	33
5.2	Определение измеримости по Жордану множества в m -мерном евклидовом пространстве.	37
5.3	Критерий измеримости.	38
5.4	Примеры неизмеримых по Жордану множеств.	39
5.5	Измеримость объединения, пересечения и разности измеримых множеств. .	39
5.6	Конечная аддитивность меры Жордана.	39
5.7	Измеримость и мера цилиндра в $(m + 1)$ -мерном пространстве.	40

6	Билет 6	41
6.1	Определенный интеграл Римана.	41
6.2	Верхние и нижние суммы Дарбу, их свойства.	42
6.3	Критерий интегрируемости функции.	43
6.4	Классы интегрируемых функций.	44
7	Билет 7	46
7.1	Некоторые свойства определенного интеграла.	46
7.2	Оценки определенного интеграла.	48
7.3	Интегралы с переменным верхним пределом. Вычисление определенных интегралов.	50
8	Билет 8	54
8.1	Геометрические приложения определенного интеграла.	54
8.2	Вычисление площади поверхности вращения.	55
8.3	Криволинейные интегралы первого рода.	56
8.4	Несобственный интеграл.	57
8.5	Несобственные интегралы от неотрицательных функций:	58
8.6	Критерий Коши сходимости несобственных интегралов.	59
8.7	Абсолютная и условная сходимость несобственных интегралов.	59
8.8	Признаки Дирихле и Абеля сходимости интегралов.	60
9	Билет 9	62
9.1	Числовые ряды.	62
9.2	Критерий Коши сходимости ряда.	63
9.3	Знакопостоянные ряды: признак сравнения сходимости, признаки Даламбера и Коши, интегральный признак.	64
9.4	Знакопеременные ряды, абсолютная и условная сходимость, признаки Лейбница, Дирихле и Абеля.	69
9.5	Независимость суммы абсолютно сходящегося ряда от порядка слагаемых.	72
9.6	Теорема Римана о перестановках членов условно сходящегося ряда.	72
9.7	Произведение абсолютно сходящихся рядов.	73
10	Билет 10	74
10.1	Понятия функциональных последовательностей и рядов.	74
10.2	Сходимость функциональных рядов и последовательностей в точке и на множестве.	75
10.3	Понятие равномерной сходимости на множестве.	75
10.4	Критерий Коши равномерной сходимости.	77
10.5	Критерии равномерной сходимости функциональной последовательности и функционального ряда.	78
10.6	Свойства равномерно сходящихся последовательностей и рядов.	79
10.7	Достаточные признаки сходимости функциональных рядов.	82
11	Билет 11	84
11.1	Степенные ряды с комплексными числами	84
11.2	Теорема 1. [Первая теорема Абеля]	84
11.3	Теорема 2. [О радиусе сходимости степенного ряда].	85
11.4	Теорема 3. [Вторая теорема Абеля].	86
11.5	Теорема 4.	87
11.6	Теорема 5. [Формула Коши-Адамара].	87

11.7 Теорема 6.	88
11.8 Теорема 7.	89
12 Билет 12	90
12.1 Степенные ряды с действительными членами.	90
12.2 Бесконечная дифференцируемость суммы степенного ряда на интервале сходимости.	90
12.3 Единственность представления функции степенным рядом.	91
12.4 Достаточные условия разложимости бесконечно дифференцируемой функции в степенной ряд	92
12.5 Ряд Тейлора	92
12.6 Формула Тейлора с остаточным членом в интегральной форме.	93
13 Билет 13	95
13.1 Разложение в ряд Тейлора основных элементарных функций: e^x , $\cos x$, $\sin x$, $\ln(1+x)$, $(1+x)^\alpha$	95
13.2 Разложение в степенной ряд комплекснозначной функции e^z	97

1. Билет 1

Введем понятия:

1. \mathbb{R}^m – m -мерное координатное пространство.
2. Точка $x = (x_1, x_2, \dots, x_m)$ – точка m -мерного пространства, $x_j \in \mathbb{R}$, $j = 1, 2, \dots, m$ – координата точки.
3. $x, y \in \mathbb{R}^m$; $\rho_e(x, y) = \sqrt{\sum_{j=1}^m (x_j - y_j)^2}$ – расстояние между точками x и y .
4. $\mathbb{E}^m = (\mathbb{R}^m, \rho_e)$ – m -мерное евклидово пространство.
5. $\mathcal{M} = (M, \rho)$ – метрическое пространство, где $M \subset \mathbb{R}^m$ – некоторое множество, $\rho(x, y)$ – функция, задающая расстояние между точками x, y множества M (метрика).
6. $B_\varepsilon(x_0) = \{x \in \mathbb{E}^m : \rho(x, x_0) < \varepsilon\}$ – m -мерный шар с центром в точке x_0 и радиусом ε (шаровая ε -окрестность точки x_0).
7. $\Pi_{r_1, r_2, \dots, r_m}(x_0) = \{x \in \mathbb{E}^m : |x_j - x_{0j}| < r_j, j = 1, 2, \dots, m\}$ – m -мерный прямоугольник с центром x_0 и сторонами $2r_1, 2r_2, \dots, 2r_m$.
8. $\Pi_r(x_0) = \{x \in \mathbb{E}^m : |x_j - x_{0j}| < r\}$ – m -мерный квадрат с центром в точке x_0 и стороной $2r$.

Предложение:

1. В любую шаровую окрестность можно вписать прямоугольную окрестность.
2. В любую прямоугольную окрестность можно вписать шаровую окрестность.

Доказательство: Пусть $B_\varepsilon(x_0)$, $\Pi_r(x_0)$ – шаровая и прямоугольная окрестности точки x_0 , $r = (r_1, r_2, \dots, r_m)$. Возьмем $\delta = \min\{r_1, r_2, \dots, r_m\}$, тогда:

1. $\Pi_\delta(x_0) \subset B_\varepsilon(x_0)$, $\delta = \frac{\varepsilon}{\sqrt{m}}$.
2. $B_\varepsilon(x_0) \subset \Pi_\delta(x_0)$, $\delta = \varepsilon$.

1.1. Предел последовательности точек в n -мерном евклидовом пространстве.

Обозначим $\mathcal{M} = (M, \rho)$, $\{x^n\}_{n=1}^\infty$ – последовательность точек в \mathcal{M} .

Определение: Последовательность $\{x^n\} \subset \mathcal{M}$ точек метрического пространства сходится к точке $a \in \mathcal{M}$, если:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \rho(x^n, a) = 0$$

$$[\lim_{n \rightarrow \infty} x^n = a] \stackrel{\text{def}}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \mapsto \rho(x^n, a) < \varepsilon]$$

Любой шар с центром в точке a и радиусом ε содержит все члены последовательности $\{x^n\}$ за исключением быть может конечного числа N .

Лемма: Сходящаяся последовательность точек ограничена.

Доказательство:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x^n = a \stackrel{def}{\Rightarrow} \lim_{n \rightarrow \infty} y_n = 0$$

где $y_n = \rho(x^n, a)$. Тогда $\{y_n\}$ – бесконечно малая последовательность $\Rightarrow \{y_n\}$ – ограничена, т. е. $\exists C > 0 : 0 \leq y_n = \rho(x^n, a) \leq C$.

Лемма: Сходящаяся последовательность точек имеет единственный предел.

Доказательство: Будем доказывать от противного: предположим, что

$$\exists a \neq b : \begin{cases} \lim_{n \rightarrow \infty} x^n = a \\ \lim_{n \rightarrow \infty} x^n = b \end{cases} \Rightarrow$$

$$(1) \quad \forall \varepsilon > 0 \exists N_1 = N_1(\varepsilon) : \forall n \geq N_1 \mapsto \rho(x^n, a) < \frac{\varepsilon}{2}$$

$$(2) \quad \forall \varepsilon > 0 \exists N_2 = N_2(\varepsilon) : \forall n \geq N_2 \mapsto \rho(x^n, b) < \frac{\varepsilon}{2}$$

Рассмотрим $N = \max\{N_1, N_2\}$, тогда:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N : \forall n \geq N \mapsto \rho(a, b) \leq \rho(x^n, a) + \rho(x^n, b) < \varepsilon$$

Таким образом, получаем, что $\rho(a, b) = 0 \Rightarrow a = b$ – противоречие.

1.2. Теорема Больцано–Вейерштрасса и критерий Коши сходимости последовательности.

Определение: Последовательность точек $\{x^n\} \subset \mathcal{M}$ ограничена, если $\exists R > 0 \forall n \mapsto \rho(x^n, 0) \leq R$.

Теорема: Пусть $\{x^n\} = \{x_1^n, x_2^n, x_3^n, \dots, x_m^n\} \subset \mathbb{E}^m$ – последовательность точек m -мерного евклидова пространства, а $a = (a_1, a_2, \dots, a_m) \in \mathbb{E}^m$ – точка m -мерного евклидова пространства, тогда

$$x^n \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} a \Leftrightarrow \forall j \quad x_j^n \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} a_j$$

Доказательство:

Необходимость (\Rightarrow)

По условию дано:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \mapsto \rho(x^n, a) < \varepsilon$$

Тогда:

$$\rho(x^n, a) = \sqrt{\sum_{j=1}^m (x_j^n - a_j)^2} \Rightarrow |x_j^n - a_j| \leq \rho(x^n, a) < \varepsilon$$

Таким образом получаем:

$$[\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \ \& \ \forall j = 1, 2, \dots, m \mapsto |x_j^n - a_j| < \varepsilon] \stackrel{def}{=} \lim_{n \rightarrow \infty} x_j^n = a_j$$

Достаточность (\Leftarrow)

Запишем определение покоординатной сходимости:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N_j = N_j(\varepsilon) : \forall n \geq N_j \mapsto |x_j - a_j| < \frac{\varepsilon}{\sqrt{m}}$$

Пусть $N = \max\{N_1, N_2, \dots, N_m\} \Rightarrow \forall n \geq N \mapsto |x_j - a_j| < \frac{\varepsilon}{\sqrt{m}}$ для всех j .

$$\rho(x^n, a) = \sqrt{\sum_{j=1}^m (x_j^n - a_j)^2} < \sqrt{m \cdot \frac{\varepsilon^2}{m}} = \varepsilon \Rightarrow$$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x^n = a$$

Теорема [Теорема Больцано-Вейерштрасса]: Из любой ограниченной последовательности $\{x^n\} \subset \mathbb{E}^m$ можно выделить сходящуюся подпоследовательность $\{x^{k_n}\} \subset \mathbb{E}^m$.

Доказательство:

$\{x^n\} \subset \mathbb{E}^m$ является ограниченной $\stackrel{def}{\Rightarrow} \exists R > 0 \forall n \mapsto \rho_e(x^n, 0) \leq R$. Тогда для всех j последовательность $\{x_j^n\}$ так же ограничена (x_j^n — j -ая компонента).

$\{x_1^n\}$ ограничена, тогда по теореме Больцано-Вейерштрасса для числовой последовательности существует подпоследовательность $\{x_1^{k_{n_1}}\}$ такая, что $x_1^{k_{n_1}} \xrightarrow{n_1 \rightarrow \infty} a_1$.

Возьмём подпоследовательность $\{x^{k_{n_1}}\} \subset \mathbb{E}^m$ (по номерам k_{n_1} выбираем из последовательности $\{x^n\}$ точки). И рассмотрим числовую последовательность $\{x_2^{k_{n_1}}\}$. Она ограничена (как подпоследовательность ограниченной последовательности) и следовательно, по теореме Больцано-Вейерштрасса существует подпоследовательность $\{x_2^{k_{n_2}}\}$ такая, что $x_2^{k_{n_2}} \xrightarrow{n_2 \rightarrow \infty} a_2$. При этом все еще справедливо $x_1^{k_{n_2}} \xrightarrow{n_2 \rightarrow \infty} a_1$.

$$\{x^n\} \subset \mathbb{E}^m \Rightarrow \{x_1^n\} \Rightarrow \{x_1^{k_{n_1}}\} \Rightarrow x_1^{k_{n_1}} \xrightarrow{n_1 \rightarrow \infty} a_1$$

$$\{x^{k_{n_1}}\} \subset \mathbb{E}^m \Rightarrow \{x_2^{k_{n_1}}\} \Rightarrow \{x_2^{k_{n_2}}\} \Rightarrow \begin{cases} x_2^{k_{n_2}} \xrightarrow{n_2 \rightarrow \infty} a_2 \\ x_1^{k_{n_2}} \xrightarrow{n_2 \rightarrow \infty} a_1 \end{cases}$$

$$\{x^{k_{n_2}}\} \subset \mathbb{E}^m \Rightarrow \{x_3^{k_{n_2}}\} \Rightarrow \{x_3^{k_{n_3}}\} \Rightarrow \begin{cases} x_3^{k_{n_3}} \xrightarrow{n_3 \rightarrow \infty} a_3 \\ x_2^{k_{n_3}} \xrightarrow{n_3 \rightarrow \infty} a_2 \\ x_1^{k_{n_3}} \xrightarrow{n_3 \rightarrow \infty} a_1 \end{cases}$$

...

$$\{x^{k_{n_m-1}}\} \subset \mathbb{E}^m \Rightarrow \{x_m^{k_{n_m-1}}\} \Rightarrow \{x_m^{k_{n_m}}\} \Rightarrow \begin{cases} x_m^{k_{n_m}} \xrightarrow[n_m \rightarrow \infty]{} a_m \\ \dots \\ x_1^{k_{n_m}} \xrightarrow[n_m \rightarrow \infty]{} a_1 \end{cases}$$

Таким образом мы нашли подпоследовательность $\{x^{k_{n_m}}\} \subset \mathbb{E}^m$ такую, что $x^{k_{n_m}} \xrightarrow[n_m \rightarrow \infty]{} a = (a_1, a_2, \dots, a_m)$.

Определение: Последовательность точек $\{x^n\} \subset \mathcal{M}$ называется *фундаментальной*, если $\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \ \& \ \forall k \geq N \mapsto \rho(x^n, x^k) < \varepsilon$.

Определение: Метрическое пространство \mathcal{M} , в котором любая фундаментальная последовательность точек $\{x^n\} \subset \mathcal{M}$ является сходящейся, называется *полным*.

Теорема [Критерий Коши]: для того, чтобы последовательность $\{x^n\} \subset \mathbb{E}^m$ сходилась, необходимо и достаточно, чтобы она была фундаментальной.

Доказательство:

Необходимость (\Rightarrow)

$$x^n \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} a \Rightarrow \forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) :$$

$$\forall n \geq N \mapsto \rho(x^n, a) < \frac{\varepsilon}{2}$$

$$\forall k \geq N \mapsto \rho(x^k, a) < \frac{\varepsilon}{2}$$

$$\rho(x^n, x^k) \leq \rho(x^n, a) + \rho(x^k, a) < \varepsilon$$

Достаточность (\Leftarrow)

Докажем, что евклидово пространство \mathbb{E}^m является полным, то есть любая фундаментальная последовательность этого пространства является сходящейся.

Рассмотрим последовательность $\{x^n\} \subset \mathcal{M}$, которая является фундаментальной. Рассмотрим по определению:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \ \& \ \forall k \geq N \mapsto \rho(x^n, x^k) < \varepsilon$$

Воспользуемся утверждением:

$$\forall j \mapsto |x_j^n - x_j^k| \leq \rho(x^n, x^k) < \varepsilon$$

Таким образом, получаем, что последовательность $\{x_j\}$ является фундаментальной, отсюда, по теореме Коши для обычной числовой последовательности, она является сходящейся, то есть:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : |x_j - a_j| < \varepsilon$$

Последовательность $\{x^n\} \subset \mathcal{M}$ имеет покоординатную сходимость, а этого, как известно, достаточно для сходимости последовательности $\{x^n\}$.

Замечание: Таким образом, мы доказали, что в евклидовом пространстве справедлив критерий Коши.

Замечание: Для произвольных метрик может существовать последовательность, которая является фундаментальной, но при этом не сходится.

Контрпример: Рассмотрим метрическое пространство $\mathcal{M} = (\mathbb{Q}, \rho)$, $\rho(x, y) = |x - y|$. Рассмотрим последовательность $x_1 = 1$, $x_{n+1} = \frac{1}{2}(x_n + \frac{2}{x_n})$. Данная последовательность является фундаментальной, но при этом не является сходящейся в \mathcal{M} .

1.3. Внутренние, предельные, изолированные точки множества.

Определение: точка x_0 множества $X \subset \mathcal{M} = (M, \rho)$ называется *внутренней точкой* множества, если существует $B_r(x_0) : B_r(x_0) \subset X$.

Определение: точка x_0 называется *предельной точкой* множества $X \subset \mathcal{M} = (M, \rho)$, если любая окрестность точки x_0 содержит по крайней мере одну точку множества X , отличную от x_0 .

$$\forall \varepsilon > 0 \exists x_\varepsilon \in X : x_\varepsilon \neq x_0 \text{ \& } x_\varepsilon \in B_\varepsilon(x_0)$$

Определение: точка x_0 множества $X \subset \mathcal{M} = (M, \rho)$ называется *изолированной точкой* множества, если у этой точки существует окрестность, не содержащая никаких других точек множества X .

$$\exists r > 0 : \forall x \in B_r(x_0) : x \neq x_0 \mapsto x \notin X$$

Определение: точка x_0 называется *точкой прикосновения* множества $X \subset \mathcal{M} = (M, \rho)$, если любая окрестность этой точки содержит по крайней мере одну точку множества X .

$$\forall \varepsilon > 0 \exists x_\varepsilon \in X : x_\varepsilon \in B_\varepsilon(x_0)$$

Определение: точка x_0 называется *граничной точкой* множества $X \subset \mathcal{M} = (M, \rho)$, если в любой ее окрестности существуют точки, как принадлежащие множеству X , так и не принадлежащие ему.

$$\forall \varepsilon > 0 \exists x'_\varepsilon \in X \text{ \& } x''_\varepsilon \notin X : x'_\varepsilon, x''_\varepsilon \in B_\varepsilon(x_0)$$

1.4. Открытые и замкнутые множества, их свойства.

Определение: Множество $X \subset \mathcal{M}$ называется *открытым*, если любая его точка внутренняя.

Определение: Множество $X \subset \mathcal{M}$ называется *замкнутым*, если оно содержит все свои предельные точки.

Теорема: открытые множества метрического пространства \mathcal{M} обладают следующими свойствами:

1. \mathcal{M}, \emptyset – открытые множества.

2. $\bigcup_{\substack{\alpha \in A \\ \text{ство}}} X_\alpha$ – объединение любого числа открытых множеств X_α есть открытое множество.
3. $\bigcap_{j=1}^K X_j$ – пересечение конечного числа открытых множеств X_j есть открытое множество.

Доказательство свойства 2: Возьмём произвольную точку $x \in X = \bigcup_{\alpha \in A} X_\alpha$, тогда существует множество X_{α_0} , такое что $x \in X_{\alpha_0}$. Но X_{α_0} – открытое множество (по условию), поэтому $\exists \varepsilon_0 : B_{\varepsilon_0}(x) \subset X_{\alpha_0} \subset X$, таким образом, получается, что любая точка множества X входит в него с некоторой ε -окрестностью, это значит, что X – открытое множество.

Доказательство свойства 3: Возьмём произвольную точку $x \in X = \bigcap_{j=1}^K X_j$, тогда $x \in X_j, j = 1, 2, \dots, K$. Но каждое X_j – открытое множество, поэтому $\forall j \exists \varepsilon_j : B_{\varepsilon_j}(x) \subset X_j$. Пусть $\varepsilon = \min\{\varepsilon_1, \varepsilon_2, \dots, \varepsilon_K\}$, тогда $\forall j B_\varepsilon(x) \subset X_j \Rightarrow B_\varepsilon(x) \subset X$, это значит, что X – открытое множество.

Теорема:

1. $Y \setminus \left(\bigcap_{\alpha \in A} X_\alpha \right) = \bigcup_{\alpha \in A} (Y \setminus X_\alpha)$
2. $Y \setminus \left(\bigcup_{\alpha \in A} X_\alpha \right) = \bigcap_{\alpha \in A} (Y \setminus X_\alpha)$

Доказательство (1):

Пусть $x \in Y \setminus \left(\bigcap_{\alpha \in A} X_\alpha \right) \Rightarrow [x \in Y] \& \left[x \notin \bigcap_{\alpha \in A} X_\alpha \right] \Rightarrow \exists \alpha' \in A : x \notin X_{\alpha'}$.

Пусть $x \in \bigcup_{\alpha \in A} (Y \setminus X_\alpha) \Rightarrow \exists \alpha' : x \in Y \setminus X_{\alpha'} \Rightarrow [x \in Y] \& [x \notin X_{\alpha'}]$.

Таким образом в обоих случаях мы приходим к тому, что $\exists \alpha' \in A : [x \in Y] \& [x \notin X_{\alpha'}]$.

Доказательство (2): Проводим аналогичные рассуждения.

Теорема: множество X метрического пространства \mathcal{M} является замкнутым $\Leftrightarrow CX = \mathcal{M} \setminus X$ – открытое множество. Причем CX называется *дополнением множества X* .

Доказательство:

Необходимость (\Rightarrow)

Доказываем от противного: предположим, что CX не является открытым множеством $\Rightarrow \exists x_0 \in CX : x_0$ не является внутренней точкой $CX \Rightarrow$

$$\forall \varepsilon > 0 \exists x_\varepsilon \neq x_0 : x_\varepsilon \notin CX \& x_\varepsilon \in B_\varepsilon(x_0)$$

тогда x_0 по определению является предельной точкой множества X и при этом $x_0 \notin X$ (т. к. $x_0 \in CX$); получается, что существует предельная точка множества X , не лежащая в этом множестве, но по условию X – замкнутое множество, а значит соержит все свои предельные точки, таким образом приходим к противоречию.

Достаточность (\Leftarrow)

Доказываем от противного: предположим, что X не является замкнутым множеством, тогда:

$$\exists x_0 \notin X : x_0 - \text{предельная точка множества } X$$

По определению предельной точки:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists x_\varepsilon \neq x_0 : x_\varepsilon \in X \ \& \ x_\varepsilon \in B_\varepsilon(x_0)$$

Тогда любой шарик $B_\varepsilon(x_0)$ с радиусом $r = \varepsilon$ и центром в точке x_0 не содержится в $CX \Rightarrow x_0$ не является внутренней точкой множества CX , но при этом $x_0 \in CX$, поскольку $x_0 \notin X$; однако, по условию CX – открытое множество, а значит должно содержать все свои внутренние точки. Таким образом, приходим к противоречию.

Теорема: замкнутые множества обладают следующими свойствами:

1. \mathcal{M}, \emptyset – замкнутые множества.
2. $\bigcap_{\alpha \in A} X_\alpha$ – пересечение любого числа замкнутых множеств X_α есть замкнутое множество.
3. $\bigcup_{j=1}^K X_j$ – объединение конечного числа замкнутых множеств X_j есть замкнутое множество.

Доказательство свойства 2: Воспользуемся теоремой о дополнении множества X : рассмотрим $C(\bigcap_{\alpha \in A} X_\alpha) = \mathcal{M} \setminus (\bigcap_{\alpha \in A} X_\alpha) = \bigcup_{\alpha \in A} (\mathcal{M} \setminus X_\alpha)$. X_α – замкнутое множество $\Rightarrow \mathcal{M} \setminus X_\alpha$ – открытое множество $\Rightarrow \bigcup_{\alpha \in A} (\mathcal{M} \setminus X_\alpha) = C(\bigcap_{\alpha \in A} X_\alpha)$ – открытое множество, тогда по теореме о дополнении множества $\bigcap_{\alpha \in A} X_\alpha$ – замкнутое множество.

Доказательство свойства 3: Воспользуемся теоремой о дополнении множества X : рассмотрим $C(\bigcup_{j=1}^K X_j) = \mathcal{M} \setminus (\bigcup_{j=1}^K X_j) = \bigcap_{j=1}^K (\mathcal{M} \setminus X_j)$. X_j – замкнутое множество $\Rightarrow \mathcal{M} \setminus X_j$ – открытое множество $\Rightarrow \bigcap_{j=1}^K (\mathcal{M} \setminus X_j) = C(\bigcup_{j=1}^K X_j)$ – открытое множество, тогда по теореме о дополнении множества $\bigcup_{j=1}^K X_j$ – замкнутое множество.

Замечание:

1. Если X – открытое множество, то $X = \text{int}X$.
2. Если X – замкнутое множество, то $\overline{X} = X$.
3. Пусть G – открытое множество, тогда в общем случае $\text{int}(\overline{G}) \neq G$.
4. Пусть F – замкнутое множество, тогда в общем случае $\overline{\text{int}F} \neq F$.

1.5. Внутренность, замыкание и граница множества.

Определение: $\text{int}X$ – совокупность всех внутренних точек множества $X \subset \mathcal{M}$ называется *внутренностью* множества X .

Определение: \overline{X} – замыкание множества $X \subset \mathcal{M}$ – операция присоединения к множеству X всех его предельных точек.

Определение: ∂X – граница множества X – совокупность всех граничных точек множества X .

1.6. Компакты.

Определение: Множество $X \subset \mathcal{M}$ называется *компактом*, если из любой последовательности его точек можно выделить сходящуюся подпоследовательность, предел которой принадлежит множеству X .

$$\forall \{x^n\} \subset X \exists \{x^{k_n}\} \subset X : \lim_{n \rightarrow \infty} x^{k_n} = a \in X$$

Определение: Множество $X \subset \mathbb{R}^m$, любые 2 точки которого можно соединить лежащей в нем непрерывной кривой, называется *линейно связным* (непрерывной кривой в m -мерной пространстве). («Введение в математический анализ.» Л. Д. Кудрявцев том 2).

Определение: Множества X_1 и X_2 метрического пространства \mathcal{M} называются *отделимыми*, если ни одно из них не содержит точек прикосновения другого.

Определение: Множество X метрического пространства \mathcal{M} называется *связным*, если его нельзя представить в виде объединения двух отделимых множеств.

Определение: Открытое связное множество называется *областью*.

1.7. Метрическое пространство.

Определение: Пусть M – произвольное множество, для любых точек $x, y \in M$ поставим в соответствие число $\rho(x, y) \geq 0$ такое что

1. $\rho(x, y) = 0 \Leftrightarrow x = y$
2. $\rho(x, y) = \rho(y, x)$
3. $\rho(x, y) \leq \rho(x, z) + \rho(z, y)$

тогда $\mathcal{M} = (M, \rho)$ называется *метрическим пространством*, а функция $\rho(x, y)$ – его метрикой.

Теорема [Неравенство Коши-Буняковского]: для любых точек $a_1, b_1, \dots, a_m, b_m$ справедливо:

$$\left(\sum_{j=1}^m a_j b_j \right)^2 \leq \sum_{j=1}^m a_j^2 \cdot \sum_{j=1}^m b_j^2$$

Доказательство: Рассмотрим многочлен:

$$p(z) = \sum_{j=1}^m (a_j + b_j z)^2 = A + 2Bz + Cz^2$$

$$A = \sum_{j=1}^m a_j^2; \quad B = \sum_{j=1}^m a_j b_j; \quad C = \sum_{j=1}^m b_j^2$$

Заметим, что при любых значениях z многочлен $p(z) \geq 0$, поскольку является суммой неотрицательных членов, тогда справедливо $B^2 - AC \leq 0 \Rightarrow B^2 \leq AC$ (дискриминант квадратного уравнения, деленный на 4). Подставляя A, B, C получаем исходное неравенство.

Теорема [Неравенство Минковского]: для любых $a_1, b_1, \dots, a_m, b_m$ справедливо:

$$\sqrt{\sum_{j=1}^m (a_j + b_j)^2} \leq \sqrt{\sum_{j=1}^m a_j^2} + \sqrt{\sum_{j=1}^m b_j^2}$$

Доказательство:

$$\sum_{j=1}^m (a_j + b_j)^2 = \sum_{j=1}^m a_j^2 + 2 \sum_{j=1}^m a_j b_j + \sum_{j=1}^m b_j^2$$

$$\sum_{j=1}^m a_j^2 + 2 \sum_{j=1}^m a_j b_j + \sum_{j=1}^m b_j^2 \stackrel{\text{К-Б}}{\leq} \left(\sqrt{\sum_{j=1}^m a_j^2} \right)^2 + 2 \sqrt{\sum_{j=1}^m a_j^2} \cdot \sqrt{\sum_{j=1}^m b_j^2} + \left(\sqrt{\sum_{j=1}^m b_j^2} \right)^2$$

Свернём правую часть по формуле квадрата суммы и получим:

$$\sum_{j=1}^m (a_j + b_j)^2 \leq \left(\sqrt{\sum_{j=1}^m a_j^2} + \sqrt{\sum_{j=1}^m b_j^2} \right)^2$$

Примеры метрических пространств:

$$\mathcal{M} = (M, \rho), \quad \rho = \begin{cases} 0, & x = y \\ 1, & x \neq y \end{cases}$$

$$\mathbb{E}^m = (\mathbb{R}^m, \rho_e), \quad \rho_e(x, y) = \sqrt{\sum_{j=1}^m (x_j - y_j)^2}$$

$$\mathcal{M} = (\mathbb{R}^m, \rho_1), \quad \rho_1(x, y) = \max_{1 \leq j \leq m} |x_j - y_j|$$

1.8. Компакты в метрическом пространстве и описание компактов в n -мерном евклидовом пространстве.

Определение: Множество $X \subset \mathbb{E}^m$ называется ограниченным, если существует m -мерный шар $\overline{B_R(0)}$ такой, что $X \subset \overline{B_R(0)}$ («Курс математического анализа» Л. Д. Кудрявцев том 2).

Теорема: $X \subset \mathbb{E}^m$ является компактом $\Leftrightarrow X$ – ограниченное и замкнутое множество.

Доказательство:

Необходимость (\Rightarrow)

Пусть $X \subset \mathbb{E}^m$ является компактом, докажем, что X является замкнутым множеством. Возьмём произвольную предельную точку a множества X и будем рассматривать её окрестности: $B_{\frac{1}{n}}(a)$:

$r_1 = 1$, тогда по определению предельной точки $\exists x_1 \neq a : x_1 \in X \ \& \ x_1 \in B_1(a)$

$r_2 = \frac{1}{2}$, тогда по определению предельной точки $\exists x_2 \neq a : x_2 \in X \ \& \ x_2 \in B_{\frac{1}{2}}(a)$

\dots

$r_n = \frac{1}{n}$, тогда по определению предельной точки $\exists x_n \neq a : x_n \in X \ \& \ x_n \in B_{\frac{1}{n}}(a)$

\dots

Таким образом, мы построили последовательность точек $\{x^n\} \subset X$ такую, что выполняется следующее:

$$\forall \varepsilon > 0 \ \exists N = \frac{1}{\varepsilon} : \forall n \geq N \mapsto \rho(a, x^n) < \frac{1}{n} < \varepsilon$$

или, что то же самое:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x^n = a$$

но, по условию, X – компакт, а значит $a \in X$, таким образом, в силу произвольности точки a , компакт X содержит все свои предельные точки, а значит, является замкнутым множеством.

Заметим, что неограниченное множество X не может быть компактом, так как в неограниченном множестве можно построить последовательность точек, которая не будет являться сходящейся.

Достаточность (\Leftarrow)

Пусть $X \subset \mathbb{E}^m$ – ограниченное, замкнутое множество. Возьмём последовательность точек $\{x^n\} \subset X$, по теореме Больцано-Вейерштрасса, в силу ограниченности этой последовательности, из нее можно выделить сходящуюся подпоследовательность $\{x^{k_n}\} \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} a$, в силу замкнутости множества $a \in X$, но тогда получается, что X – компакт.

2. Билет 2

2.1. Предел числовой функции нескольких переменных.

Обозначения: $\mathcal{M} = (\mathbb{M}, \rho)$, $a \in \mathcal{M}$, $\mathcal{U}(a)$, $w = f(x)$ - некоторая функция, заданная в $\mathcal{U}(a)$, за исключением, быть может, самой точки a .

Определение (по Гейне):

$$[\lim_{x \rightarrow a} f(x) = b] \stackrel{\text{def}}{=} \left[\forall \{x^n\} : [x^n \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} a] \ \& \ [x^n \neq a \ \forall n] \mapsto w^n = f(x^n) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} b \right].$$

Определение (по Коши):

$$[\lim_{x \rightarrow a} f(x) = b] \stackrel{\text{def}}{=} [\forall \varepsilon > 0 \ \exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : [\forall x : 0 < \rho(x, a) < \delta] \mapsto |f(x) - b| < \varepsilon].$$

Пример:

$$\begin{aligned} w = f(x, y) &= \frac{2xy}{x^2 + y^2}, \\ x^2 + y^2 &\neq 0, \quad \vec{0} = (0, 0) \\ [\lim_{(x, y) \rightarrow \vec{0}} f(x, y) &- \text{ не существует}] \end{aligned}$$

Рассмотрим последовательности:

$$\begin{aligned} \{z^n\}' &= \{(x^n, y^n)\} = \left(\frac{1}{n}, \frac{1}{n}\right), \quad \rho(\{z^n\}', \vec{0}) = \frac{\sqrt{2}}{n} \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} 0 \\ \{z^n\}'' &= \{(x^n, y^n)\} = \left(-\frac{1}{n}, \frac{1}{n}\right), \quad \rho(\{z^n\}'', \vec{0}) = \frac{\sqrt{2}}{n} \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} 0 \end{aligned}$$

Однако $f(\{z^n\}') = 1$, $f(\{z^n\}'') = -1$. Поэтому предел функции $f(x, y)$ в точке $\vec{0} = (0, 0)$ не существует.

Предложение: Пусть $a \in \mathcal{M}$ и $w = f(x)$, $w = g(x)$ определены в $\mathcal{U}(a)$, за исключением, быть может, самой точки a ; $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = b$, $\lim_{x \rightarrow a} g(x) = c$. Тогда:

$$\lim_{x \rightarrow a} [f(x) \pm g(x)] = b \pm c$$

$$\lim_{x \rightarrow a} [f(x) \cdot g(x)] = b \cdot c$$

$$\lim_{x \rightarrow a} \left[\frac{f(x)}{g(x)} \right] = \frac{b}{c}, \quad c \neq 0$$

Доказательство аналогично доказательству для функций одной переменной.

Определение: Функция $\alpha = \alpha(x)$, определенная в $\mathcal{U}(a)$, за исключением, быть может, самой точки a , называется бесконечно малой, если $\lim_{x \rightarrow a} \alpha(x) = 0$.

Предложение:

$$[f(x) : \lim_{x \rightarrow a} f(x) = b] \Rightarrow [\alpha = \alpha(x) = f(x) - b - \text{бесконечно малая при } x \rightarrow a].$$

2.2. Предел функции по множеству.

Обозначения: a - предельная точка множества $A \subset \mathcal{M}$, $w = f(x)$ определена в A .

Определение: Предел функции по множеству:

$$\left[\lim_{x \xrightarrow{x \in A} a} f(x) = b \right] \stackrel{def}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : \forall x \in A : 0 < \rho(x, a) < \delta \mapsto |f(x) - b| < \varepsilon]$$

Обозначения: $D \subset \mathbb{E}^m$ - неограниченное множество. $w = f(x)$ - определена на D .

Определение: Предел функции при $x \rightarrow \infty$:

$$\left[\lim_{x \rightarrow \infty} f(x) = b \right] \stackrel{def}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : \forall x \in D : \rho(x, \vec{0}) > \delta \mapsto |f(x) - b| < \varepsilon]$$

Здесь $\vec{0} = (0, \dots, 0)_m$.

Определение: Пусть функция $w = f(x)$ определена на множестве $\prod_r(x_0, y_0) = \{(x, y) \in \mathbb{E}^2 : 0 < |x - x_0| < r_1, 0 < |y - y_0| < r_2\}$ и $\forall x \in (x_0 - r_1, x_0 + r_1), x \neq x_0 \exists \lim_{y \rightarrow y_0} f(x, y) = \varphi(x), \exists \lim_{x \rightarrow x_0} \varphi(x) = b$. Тогда говорят, что у функции $w = f(x, y)$ существует повторный предел $\lim_{x \rightarrow x_0} \lim_{y \rightarrow y_0} f(x, y) = b$. Пусть $\forall y \in (y_0 - r_2, y_0 + r_2), y \neq y_0 \exists \lim_{x \rightarrow x_0} f(x, y) = \psi(y), \exists \lim_{y \rightarrow y_0} \psi(y) = c$. Тогда говорят, что у функции $w = f(x, y)$ существует повторный предел $\lim_{y \rightarrow y_0} \lim_{x \rightarrow x_0} f(x, y) = c$.

Замечание: Из существования предела функции в точке не следует существование повторных пределов. А из существования и равенства повторных пределов не следует существования предела в точке.

Примеры:

1.

$$w = f(x, y) = \frac{2xy}{x^2 + y^2}, x^2 + y^2 \neq 0$$

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

Но предел функции в точке $(0, 0)$ не существует.

2.

$$w = f(x, y) = \begin{cases} x \cdot \sin\left(\frac{1}{y}\right), & y \neq 0 \\ 0, & y = 0 \end{cases}$$

$$|f(x, y)| \leq |x| \leq \sqrt{x^2 + y^2} < \delta = \varepsilon$$

$$[\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : \forall x \in A : 0 < \rho(x, a) < \delta \mapsto |f(x) - b| < \varepsilon]$$

$$\lim_{(x, y) \xrightarrow{y \neq 0} \vec{0}} f(x, y) = 0 \quad \lim_{y \rightarrow 0} \lim_{x \rightarrow 0} f(x, y) = 0, \text{ однако}$$

$\lim_{x \rightarrow 0} \lim_{y \rightarrow 0} f(x, y)$ - не существует.

Предложение: Пусть $w = f(x, y)$ определена в $\prod_r(x_0, y_0) = \{(x, y) \in \mathbb{E}^2 : 0 < |x - x_0| < r_1, 0 < |y - y_0| < r_2\}$ и $\lim_{(x, y) \rightarrow (x_0, y_0)} f(x, y) = b$. Пусть, кроме того, $\forall x : 0 < |x - x_0| < r_1 \exists \lim_{y \rightarrow y_0} f(x, y) = \varphi(x)$ и $\forall y : 0 < |y - y_0| < r_2 \exists \lim_{x \rightarrow x_0} f(x, y) = \psi(y)$. Тогда повторные пределы существуют и равны числу b .

2.3. Непрерывность функции нескольких переменных в точке и по множеству.

Определение: Функция $w = f(x)$, определенная в $\mathcal{U}(a) \subset \mathcal{M}$ называется непрерывной в точке a , если $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = f(a)$.

Обозначения: $w = f(x)$ определена на $A \subset \mathcal{M}$ и a предельная точка множества A .

Определение: Функция $w = f(x)$ называется непрерывной в точке a по множеству A , если $\lim_{\substack{x \rightarrow a \\ x \in A}} f(x) = f(a)$.

Определение: Функция $w = f(x)$ называется непрерывной на множестве $\mathbb{X} \subset \mathcal{M}$, если она непрерывна в каждой точке множества \mathbb{X} по множеству \mathbb{X} .

Предложение:

$$[f - \text{непрерывна в точке } a \in \mathcal{M}] \Leftrightarrow [\Delta f(x) = f(x) - f(a) - \text{бесконечно малая при } x \rightarrow a]$$

Обозначения:

$$w = f(x), \quad x \in \mathbb{E}^m; \quad \Delta_k f(x^0, \Delta x_k) = f(x_1^0, \dots, x_{k-1}^0, x_k^0 + \Delta x_k, x_{k+1}^0, \dots, x_m^0) - f(x^0)$$

Частичное приращение функции $w = f(x)$ в точке $x^0 = (x_1^0, \dots, x_m^0)$ соответствуют приращению Δx_k аргумента x_k .

Определение: Функция $w = f(x)$ называется непрерывной в точке x^0 по переменной x_k , если $\lim_{\Delta x_k \rightarrow 0} \Delta_k f(x^0, \Delta x_k) = 0$.

Замечание: Из непрерывности функции $w = f(x)$ в точке $x^0 = (x_1^0, \dots, x_m^0)$ следует непрерывность функции по каждой переменной, но из непрерывности функции по каждой переменной не следует непрерывность функции в точке.

Контрпримеры:

1.

$$w = f(x, y) = \begin{cases} \frac{xy}{x^2 + y^2}, & x^2 + y^2 \neq 0; \\ 0, & x^2 + y^2 = 0. \end{cases}$$

$$\Delta_x f(\vec{0}, x) = \Delta_y f(\vec{0}, y) = 0.$$

Функция непрерывна в точке $\vec{0} = (0, 0)$ по переменной x и по переменной y . Однако пусть $y = kx$, тогда:

$$\lim_{(x, y) \rightarrow \vec{0}} f(x, y) = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{kx^2}{(1+k^2)x^2} = \frac{k}{1+k^2} \neq 0, \text{ при } k \neq 0. \text{ Поэтому функция } f(x, y) \text{ не является непрерывной в точке } \vec{0}.$$

2.

$$w = f(x, y) = \begin{cases} \frac{x^2 y}{x^4 + y^2}, & x^2 + y^2 \neq 0, \\ 0, & x^2 + y^2 = 0; \end{cases}$$

Функция f непрерывна в точке $\vec{0}$ по переменной x и по переменной y , непрерывна по множеству $y = kx$, однако не является непрерывной в точке $\vec{0}$ по множеству $y = x^2$:
 $\lim_{(x,y) \rightarrow \vec{0}} f(x, y) = \frac{1}{2} \neq 0$.

2.4. Свойства функций, непрерывных на компакте: ограниченность, достижение точных нижней и верхней граней, равномерная непрерывность (теорема Кантора).

Предложение: Пусть функции $w = f(x)$ и $w = g(x)$ непрерывны в точке $a \in \mathcal{M}$. Тогда функции $f \pm g$, $f \cdot g$, $\frac{f}{g}$ - непрерывны в точке a , в случае частного $g(a) \neq 0$.

Обозначения: $x \in \mathbb{E}^m$, $x_j = \varphi_j(t)$, $t \in T \subset \mathbb{E}^k$, $j = 1, \dots, m$; $\forall t \in T \subset \mathbb{E}^k \mapsto x \in \mathbb{X} \subset \mathbb{E}^m$.

Теорема [О непрерывности суперпозиции функций]: Пусть функция $x_j = \varphi_j(t)$, $j = 1, \dots, m$, непрерывна в точке a , функция f - непрерывна в точке $b = (b_1, \dots, b_m)$, причем $b_j = \varphi_j(a)$, $j = 1, \dots, m$. На $T \subset \mathbb{E}^k$ определена сложная функция

$$F(t) = f(\varphi_1(t), \dots, \varphi_m(t))$$

Тогда функция $F(t) = f(\varphi_1(t), \dots, \varphi_m(t))$ непрерывна в точке a .

Доказательство:

$$[w = f(x) \text{ непрерывна в точке } b] \stackrel{\text{def}}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : [\forall x : \rho(x, b) < \delta] \mapsto |f(x) - f(b)| < \varepsilon]$$

$$[\varphi_j \text{ непрерывна в точке } a, j = 1, \dots, m] \stackrel{\text{def}}{=} [\forall \delta > 0 \exists \sigma_j = \sigma_j(\delta) > 0,$$

$$j = 1, \dots, m : [\forall t : \rho(t, a) < \sigma_j] \mapsto |\varphi_j(t) - \varphi_j(a)| < \frac{\delta}{\sqrt{m}}]$$

$$\exists \sigma = \sigma(\varepsilon) = \min\{\sigma_1, \dots, \sigma_m\} \Rightarrow \forall t : \rho(t, a) < \sigma \Rightarrow |x_j - b_j| < \frac{\delta}{\sqrt{m}}$$

$$\rho(x, b) = \sqrt{\sum_{j=1}^m (x_j - b_j)^2} < \sqrt{\sum_{j=1}^m \frac{\delta^2}{m}} = \delta \mapsto |f(x) - f(b)| < \varepsilon \Rightarrow$$

$$\Rightarrow |f(\varphi_1(t), \dots, \varphi_m(t)) - f(\varphi_1(a), \dots, \varphi_m(a))| < \varepsilon \Rightarrow |F(t) - F(a)| < \varepsilon$$

$$[\forall \varepsilon > 0 \exists \sigma > 0 : [\forall t : \rho(t, a) < \sigma] \mapsto |F(t) - F(a)| < \varepsilon] \stackrel{\text{def}}{=} [F(t) \text{ - непрерывна в точке } a.]$$

Теорема [О локальном сохранении знака непрерывной функции]: пусть $w = f(x)$ определена на $\mathcal{U}(a) \subset \mathbb{E}^m$ и непрерывна в точке $x = a$, $f(a) \neq 0$. Тогда $\exists \delta > 0 : \forall x : \rho(x, a) < \delta \mapsto f(x) \cdot f(a) > 0$.

Доказательство: используется "ε - δ" определение непрерывности функции функции в точке и выбором $0 < \varepsilon < |f(a)|$.

Теорема Вейерштрасса: Пусть функция $w = f(x)$ непрерывна на компакте $\mathbb{X} \subset \mathbb{E}^m$. Тогда она ограничена на \mathbb{X} и достигает на \mathbb{X} своих верхней и нижней граней.

Доказательство(по Бесову): проведем доказательство лишь для случая верхней грани. Как увидим, оно повторяет доказательство теоремы Вейерштрасса для одномерного случая: $\mathbb{X} = [a, b]$.

Пусть $B := \sup_{\mathbb{X}} f \leq +\infty$. Из определения верхней грани следует, что существует последовательность точек $\{x^n\}$, $x^n \in \mathbb{X} \forall n \in \mathbb{N}$ такая, что

$\lim_{n \rightarrow \infty} f(x^n) = B$. Последовательность $\{x^n\}$ ограничена в силу ограниченности множества \mathbb{X} . В силу теоремы Больцано-Вейерштрасса выделим из $\{x^n\}$ сходящуюся подпоследовательность $\{x^{n_k}\}_{k=1}^{\infty}$. Пусть $x^0 = \lim_{k \rightarrow \infty} x^{n_k}$. Точка x^0 принадлежит \mathbb{X} в силу замкнутости \mathbb{X} . Следовательно, f непрерывна в точке x^0 по множеству \mathbb{X} .

Теперь из соотношений

$$f(x^{n_k}) \rightarrow B, \quad f(x^{n_k}) \rightarrow f(x^0) \text{ при } k \rightarrow \infty$$

вытекает, что $f(x^0) = B$, т.е. что верхняя грань функции f достигается в точке $x^0 \in \mathbb{X}$. Следовательно, верхняя грань $\sup_{\mathbb{X}} f$ конечна, а функция f ограничена сверху на \mathbb{X} .

Аналогично доказывается, что функция f достигает своей нижней грани на \mathbb{X} и ограничена снизу на \mathbb{X} . Теорема доказана.

Определение: функция f называется равномерно непрерывной на множестве $\mathbb{X} \subset \mathcal{M}$, если для любого положительного числа ε найдется положительное число δ такое, что для всех точек $x', x'' \in \mathbb{X}$, таких, что $\rho(x', x'') < \delta$, выполняется неравенство $|f(x') - f(x'')| < \varepsilon$.

На языке кванторов: $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 : \forall x', x'' \in \mathbb{X}, \rho(x', x'') < \delta \mapsto |f(x') - f(x'')| < \varepsilon$

Теорема [Теорема Кантора]: Пусть функция f непрерывна на компакте $\mathbb{X} \subset \mathbb{E}^m$. Тогда f равномерно непрерывна на \mathbb{X} .

Доказательство(по Бесову): Предположим, что теорема неверна, то есть, что существует f , непрерывная, но не равномерно непрерывная на \mathbb{X} . Тогда:

$$\exists \varepsilon_0 > 0 : \forall \delta > 0 \exists x, y \in \mathbb{X} : \rho(x, y) < \delta : |f(x) - f(y)| \geq \varepsilon_0$$

Будем в качестве δ брать $\delta_n = \frac{1}{n}$ и обозначать через x^n, y^n соответствующую пару точек x, y . Тогда имеем:

$$x^n, y^n \in \mathbb{X}, \quad \rho(x^n, y^n) < \frac{1}{n},$$

$$|f(x^n) - f(y^n)| \geq \varepsilon_0 > 0.$$

Выделим из последовательности x^n сходящуюся подпоследовательность $\{x^{n_k}\}_{k=1}^{\infty}$, $\lim_{k \rightarrow \infty} x^{n_k} = x^0$, что возможно по теореме Больцано-Вейерштрасса в силу ограниченности x^n . Тогда из

$\rho(x^n, y^n) < \frac{1}{n}$ следует, что $\lim_{k \rightarrow \infty} y^{n_k} = x^0$. Точка $x^0 \in \mathbb{X}$, так как \mathbb{X} замкнуто. В силу непрерывности f в точке x^0 по множеству \mathbb{X} имеем: $f(x^{n_k}) \rightarrow f(x^0)$, $f(y^{n_k}) \rightarrow f(x^0)$ при $k \rightarrow \infty$, так что

$$|f(x^{n_k}) - f(y^{n_k})| \leq |f(x^{n_k}) - f(x^0)| + |f(y^{n_k}) - f(x^0)| \rightarrow 0, \text{ при } k \rightarrow \infty$$

Это противоречит тому, что

$$|f(x^{n_k}) - f(y^{n_k})| \geq \varepsilon_0 > 0 \quad \forall k \in \mathbb{N}$$

Теорема доказана.

2.5. Теорема о промежуточных значениях функции, непрерывной в области.

Теорема [Прохождение непр. функции через промежуточные значения]:

Пусть функция $w = f(x)$ непрерывна на линейно связном множестве $\mathbb{X} \subset \mathbb{E}^m$, $a, b \in \mathbb{X}$, $f(a) = A$, $f(b) = B$. Пусть число C лежит между числами A и B . Тогда на любой кривой соединяющей точки a и b и лежащей в \mathbb{X} , найдется точка c , такая, что $f(c) = C$.

Доказательство: Пусть $[\alpha, \beta] \subset \mathbb{E}^1$, $x_j = \varphi_j(t)$, $\varphi_j(\alpha) = a_j$, $\varphi_j(\beta) = b_j$, $j = 1, \dots, m$; $a = (a_1, \dots, a_m)$, $b = (b_1, \dots, b_m)$, φ_j непрерывна на $[\alpha, \beta]$.

$$\Gamma = \{\varphi_1(t), \dots, \varphi_m(t), \alpha \leq t \leq \beta\}$$

соединяющая точки a и b , $\Gamma \subset \mathbb{X}$.

Рассмотрим функцию одной переменной $F(t) = f(\varphi_1(t), \dots, \varphi_m(t))$. По теореме о непрерывности суперпозиции функций $F(t)$ - непрерывна на $[\alpha, \beta]$, $F(\alpha) = A$, $F(\beta) = B \Rightarrow \exists \gamma \in (\alpha, \beta) : F(\gamma) = C$ (т. Больцано - Коши). Тогда $c = (\varphi_1(\gamma), \dots, \varphi_m(\gamma)) \Rightarrow f(c) = C$.

3. Билет 3

3.1. Частные производные функции нескольких переменных.

Определение: f определена $\mathcal{U}(a) \subset \mathbb{E}^m$. Если существует и конечен $\lim_{\Delta x_k \rightarrow 0} \frac{\Delta_k f(a, \Delta x_k)}{\Delta x_k} = b \in \mathbb{R}$, то этот предел называется частной производной функции $w = f(x)$ в точке a по аргументу x_k .

Обозначение. $\frac{\partial f}{\partial x_k}(a)$ или f'_{x_k}

$$\Delta_k f(a, \Delta x_k) = f(a_1, \dots, a_{k-1}, a_k + \Delta x_k, a_{k+1}, \dots, a_m) - f(a_1, \dots, a_m)$$

(Только на месте k -ого аргумента есть приращение).

Замечания.

1. При вычислении $\frac{\partial f}{\partial x_k}(x)$ вычисляется как для функций одной переменной x_k при фиксированных остальных переменных (остальные переменные – постоянные).

2. $\left[\exists \frac{\partial f}{\partial x_j}(a), j = 1, \dots, m \right] \not\Rightarrow [f \text{ непрерывна в точке } a]$

Контрпример.

$$\omega = f(x, y) = \begin{cases} \frac{2xy}{x^2 + y^2}, & x^2 + y^2 \neq 0, \\ 0, & x^2 + y^2 = 0 \end{cases}$$

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

$$\frac{\partial f}{\partial y}(0,0) = \lim_{y \rightarrow 0} \frac{f(0, y) - f(0, 0)}{y} = 0$$

Однако, f не является непрерывной в точке $(0, 0)$, т.к. в этой точке у нее не существует $\lim_{(x,y) \rightarrow (0,0)} f(x, y)$.

3. Определение частной производной функции $w = f(x)$ дано для внутренней точки множества определения функции. Оно не пригодно для граничной предельной точки множества, поскольку в граничной точке не всегда можно определить частное приращение. Поэтому частная производная в граничной предельной точке множества определения функции находится как предел частной производной по множеству.

Точка $a \in X$ – предельная граничная точка.

$$\frac{\partial f}{\partial x}(a) = \lim_{\substack{(x,y) \rightarrow (a_1, a_2) \\ (x,y) \in X}} \frac{\partial f}{\partial x}(x, y)$$

$$\frac{\partial f}{\partial y}(a) = \lim_{\substack{(x,y) \rightarrow (a_1, a_2) \\ (x,y) \in X}} \frac{\partial f}{\partial y}(x, y)$$

3.2. Дифференцируемость функции в точке

Некоторые замечания, которые нужны для определения дифференцируемости функции в точке:

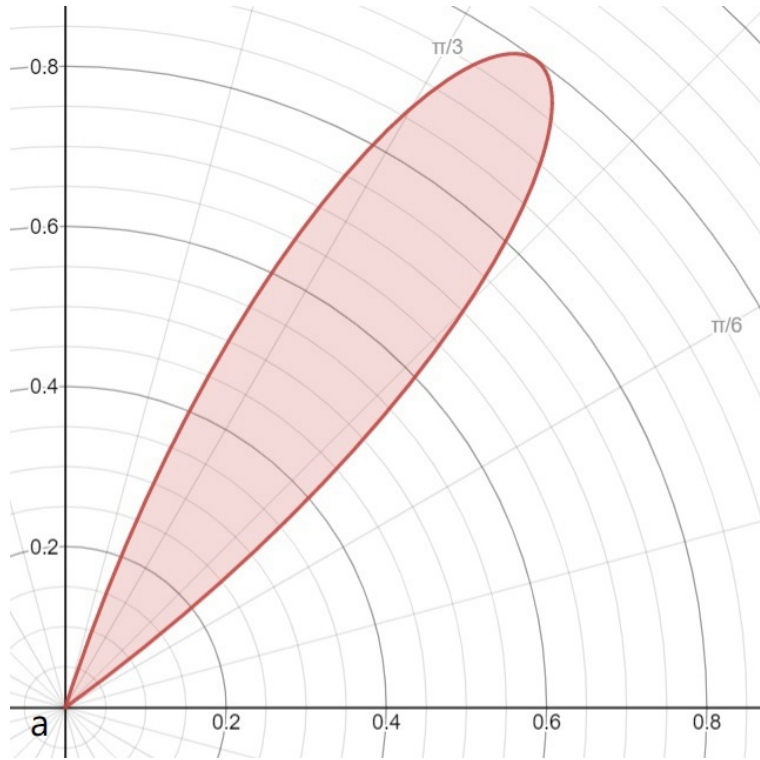


Рис. 1: Пример того, как частную производную следует искать как предел по множеству в точке a .

Рассмотрим $w = f(x)$, она определена в $\mathcal{U}(a)$, $a = (a_1, \dots, a_m)$, $\Delta x = (\Delta x_1, \dots, \Delta x_m) : a + \Delta x = (a_1 + \Delta x_1, \dots, a_m + \Delta x_m) \in \mathcal{U}(a)$

Рассмотрим $\rho = \sqrt{(\Delta x_1)^2 + \dots + (\Delta x_m)^2}$, $\rho \rightarrow 0 \Leftrightarrow \Delta x \rightarrow \bar{0}$, где $\bar{0} = \overbrace{(0, 0, \dots, 0)}^m$.

$\Delta f(a, \Delta x) = f(a + \Delta x) - f(a)$ – Полное приращение функции в точке a , соответствующее приращению аргументов $\Delta x = (\Delta x_1, \dots, \Delta x_m)$.

Определение: Функция f называется дифференцируемой в точке a , если
Условие 1:

$$\Delta f(a, \Delta x) = A_1 \Delta x_1 + \dots + A_m \Delta x_m + \alpha_1(\Delta x) \Delta x_1 + \dots + \alpha_m(\Delta x) \Delta x_m$$

где A_j – постоянные, $j = 1, \dots, m$, не зависят от Δx , $\alpha_j = \alpha_j(\Delta x)$ – б.м. функции при $\Delta x \rightarrow 0$; $\alpha_j = 0$ при $\Delta x = \bar{0}$.

Условие 2:

$$\Delta f(a, \Delta x) = A_1 \Delta x_1 + \dots + A_m \Delta x_m + o(\rho), \rho \rightarrow 0$$

(По сути ρ – расстояние от точки Δx до $\bar{0}$).

Предложение. Условия 1 и 2 определения дифференцируемости функции в точке эквивалентны.

Доказательство.

$1 \Rightarrow 2$

Покажем, что $\alpha_1(\Delta x) \Delta x_1 + \dots + \alpha_m(\Delta x) \Delta x_m = o(\rho)$, $\rho \rightarrow 0$, $\rho \neq 0$.

Заметим, что

$$\left| \frac{\Delta x_j}{\rho} \right| \leq 1, \quad \rho = \sqrt{(\Delta x_1)^2 + \dots + (\Delta x_m)^2}$$

$$|\alpha_1 \Delta x_1 + \dots + \alpha_m \Delta x_m| \leq \rho \cdot \left(|\alpha_1| \frac{|\Delta x_1|}{\rho} + \dots + |\alpha_m| \frac{|\Delta x_m|}{\rho} \right) \leq \rho \cdot (|\alpha_1| + \dots + |\alpha_m|)$$

В силу того, что $\rho \rightarrow 0 \Leftrightarrow \Delta x \rightarrow \bar{0}$, $|\alpha_1| + \dots + |\alpha_m|$ также стремиться к нулю, как конечная сумма б.м. функций.

Значит, $\rho \cdot (|\alpha_1| + \dots + |\alpha_m|) = o(\rho)$. Показали, что это выражение действительно есть б.м. функция.

2 \Rightarrow 1

$$\begin{aligned} o(\rho) &= \frac{\rho^2}{\rho} \frac{o(\rho)}{\rho} = \frac{(\Delta x_1)^2 + \dots + (\Delta x_m)^2}{\rho} \frac{o(\rho)}{\rho} \\ o(\rho) &= \left(\frac{\Delta x_1}{\rho} \frac{o(\rho)}{\rho} \right) \Delta x_1 + \dots + \left(\frac{\Delta x_m}{\rho} \frac{o(\rho)}{\rho} \right) \Delta x_m \end{aligned}$$

Понятно, что $\alpha_j = \frac{\Delta x_j}{\rho} \frac{o(\rho)}{\rho}$, но $\frac{\Delta x_j}{\rho}$ величина ограниченная, а $\frac{o(\rho)}{\rho} \rightarrow 0$, $\rho \rightarrow 0 \Rightarrow$ при $\Delta x \rightarrow \bar{0}$. $\alpha_j = 0$, $j = 1, \dots, m$, только при $\Delta x = \bar{0}$.

Доказано.

3.3. Достаточные условия дифференцируемости функции в точке

Теорема 2. Пусть $w = f(x)$ определена в $\mathcal{U}(a) \subset \mathbb{E}^m$ и в этой окрестности существуют $\frac{\partial f}{\partial x_j}$, $j = 1, \dots, m$. Если $\frac{\partial f}{\partial x_j}$, $j = 1, \dots, m$ непрерывны в точке a , то функция f дифференцируема в точке a .

Доказательство. Проведем доказательство для $m = 2$, $w = f(x, y)$, $a = (a_1, a_2)$.

Рассмотрим точку $(a_1 + \Delta x, a_2 + \Delta y) \in \mathcal{U}(a)$.

Рассмотрим

$$\Delta f(a, (\Delta x, \Delta y)) = f(a_1 + \Delta x, a_2 + \Delta y) - f(a_1, a_2)$$

$$\Delta f(a, (\Delta x, \Delta y)) = f(a_1 + \Delta x, a_2 + \Delta y) - f(a_1, a_2 + \Delta y) + f(a_1, a_2 + \Delta y) - f(a_1, a_2)$$

Введем функцию $\varphi(x) = f(x, a_2 + \Delta y)$ и $\psi(y) = f(a_1, y)$

$$\begin{aligned} \Delta f(a, (\Delta x, \Delta y)) &= \Delta \varphi(a_1, \Delta x) + \Delta \psi(a_2, \Delta y) = \\ &= \varphi(a_1 + \Delta x) - \varphi(a_1) + \psi(a_2 + \Delta y) - \psi(a_2) \end{aligned}$$

По теореме Лагранжа для функции одной переменной: $\exists \theta_1 : 0 < \theta_1 < 1$ и $\exists \theta_2 : 0 < \theta_2 < 1$:

$$f(a_1 + \Delta x, a_2 + \Delta y) - f(a_1, a_2 + \Delta y) = f'_x(a_1 + \theta_1 \Delta x, a_2 + \Delta y) \Delta x$$

$$f(a_1, a_2 + \Delta y) - f(a_1, a_2) = f'_y(a_1, a_2 + \theta_2 \Delta y) \Delta y$$

$$f'_x(a_1 + \theta_1 \Delta x, a_2 + \Delta y) = f'_x(a_1, a_2) + \alpha_1(\Delta x, \Delta y); \quad \alpha_1 \rightarrow 0, \quad (\Delta x, \Delta y) \rightarrow (0, 0)$$

$$f'_y(a_1, a_2 + \theta_2 \Delta y) = f'_y(a_1, a_2) + \alpha_2(\Delta x, \Delta y); \quad \alpha_2 \rightarrow 0, \quad (\Delta x, \Delta y) \rightarrow (0, 0)$$

$$\Delta f(a, (\Delta x, \Delta y)) = f'_x(a) \Delta x + f'_y(a) \Delta y + \alpha_1 \Delta x + \alpha_2 \Delta y$$

Получили в точности определение дифференцируемости функции f в точке a .
Доказано.

Примеры. (Доказательство дифференцируемости ф-ции в точке)

$$w = f(x, y), \bar{0} = (0, 0), \rho = \sqrt{x^2 + y^2}$$

$$f(x, y) - f(0, 0) = \frac{\partial f}{\partial x}(0, 0)\Delta x + \frac{\partial f}{\partial y}(0, 0)\Delta y + o(\rho), \rho \rightarrow 0.$$

Пример 1. $f(x, y) = y^2 \sin x$

Заметим, что $f(x, 0) = f(0, y) = f(0, 0) = 0$

Из определения частной производной: $\frac{\partial f}{\partial x}(0, 0) = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{f(x, 0) - f(0, 0)}{x} = 0.$

$$\frac{\partial f}{\partial y}(0, 0) = \lim_{y \rightarrow 0} \frac{f(0, y) - f(0, 0)}{y} = 0.$$

Частные производные равны нулю, значит, надо показать, что $f(x, y) = o(\rho)$, $\rho \rightarrow 0$.
Надо показать, что $F(x, y) = \frac{f(x, y)}{\sqrt{x^2 + y^2}} \rightarrow 0$, при $(x, y) \rightarrow (0, 0)$.

$$|F(x, y)| = \left| \frac{y^2 \sin x}{\sqrt{x^2 + y^2}} \right| \leq \frac{y^2}{\sqrt{x^2 + y^2}} \leq [|y| \leq \sqrt{x^2 + y^2}] \leq \frac{\sqrt{x^2 + y^2}^2}{\sqrt{x^2 + y^2}} = \sqrt{x^2 + y^2} \leq \delta = \varepsilon$$

$$[\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) = \varepsilon : \forall (x, y) : 0 < \rho = \sqrt{x^2 + y^2} < \delta \mapsto |F(x, y)| < \varepsilon] \stackrel{def}{=} \left[\lim_{(x, y) \rightarrow (0, 0)} F(x, y) = 0 \right] \Leftrightarrow [f(x, y) = o(\rho), \rho \rightarrow 0].$$

Пример 2. $f(x, y) = \sqrt{|xy|}$, $\bar{0} = (0, 0)$

$$f(x, 0) = f(0, y) = f(0, 0) = 0 \Rightarrow \frac{\partial f}{\partial x}(0, 0) = \frac{\partial f}{\partial y}(0, 0) = 0$$

$$F(x, y) = \frac{\sqrt{|xy|}}{\sqrt{x^2 + y^2}}.$$

Перейдем к полярным координатам: $x = \rho \cos \varphi$, $y = \rho \sin \varphi$, $F(x, y) = \sqrt{|\cos \varphi \sin \varphi|}$

$$\varphi = \frac{\pi}{2} \Rightarrow F(\rho, \varphi) = 0$$

$$\varphi = \frac{\pi}{4} \Rightarrow F(\rho, \varphi) = \frac{1}{\sqrt{2}} \neq 0$$

Значит, f не является дифференцируемой в точке $(0, 0)$.

Пример 3. (Очень важный для понимания теории)

$$f(x, y) = \begin{cases} (x^2 + y^2) \sin \frac{1}{\sqrt{x^2 + y^2}}, & x^2 + y^2 \neq 0, \\ 0, & x^2 + y^2 = 0 \end{cases}$$

$$f(x, 0) = x^2 \sin \frac{1}{|x|}, x \neq 0$$

$$f(0, y) = y^2 \sin \frac{1}{|y|}, y \neq 0$$

$$f(0, 0) = 0$$

$$\frac{\partial f}{\partial x}(0, 0) = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{f(x, 0) - f(0, 0)}{x} = \lim_{x \rightarrow 0} x \sin \frac{1}{|x|} = 0$$

$$\frac{\partial f}{\partial y}(0, 0) = \lim_{y \rightarrow 0} \frac{f(0, y) - f(0, 0)}{y} = \lim_{y \rightarrow 0} y \sin \frac{1}{|y|} = 0$$

Теперь докажем, что эта функция дифференцируема в $(0, 0)$

Введем функцию

$$F(x, y) = \frac{f(x, y)}{\sqrt{x^2 + y^2}} = \sqrt{x^2 + y^2} \sin \frac{1}{\sqrt{x^2 + y^2}}$$

$$|F(x, y)| \leq \sqrt{x^2 + y^2} < \delta = \varepsilon$$

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) = \varepsilon : \forall (x, y) : 0 < \rho = \sqrt{x^2 + y^2} < \delta \mapsto |F(x, y)| < \varepsilon \stackrel{def}{=}$$

$$[\lim_{(x,y) \rightarrow (0,0)} F(x, y) = 0] \Leftrightarrow [f(x, y) = o(\rho), \rho \rightarrow 0] \Rightarrow$$

$\Rightarrow f$ дифференцируема в $(0, 0)$

Посмотрим на частные производные этой функции по x и y вне точки $(0, 0)$:

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x, y) = 2x \sin \frac{1}{\sqrt{x^2 + y^2}} - \frac{x^2 + y^2}{(\sqrt{x^2 + y^2})^3} \cos \frac{1}{\sqrt{x^2 + y^2}}$$

$\lim_{(x,y) \rightarrow (0,0)} \frac{\partial f}{\partial x}(x, y)$ не существует $\Rightarrow f'_x$ не является непрерывной в $(0, 0)$.

Пример показывает, что непрерывность частных производных в точке не является необходимым условием дифференцируемости функции.

Замечание. Непрерывность частных производных функции f в точке не является необходимым условием дифференцируемости функции в точке. Это условие достаточно (Теорема 2).

3.4. Дифференцируемость сложной функции

Рассматриваем функции $x_j = \varphi_j(t)$ в окрестности точки $t^0 = (t_1^0, \dots, t_k^0) \in \mathbb{E}^k$, $j = 1, \dots, m$. Рассматриваем функцию $w = f(x)$, которая определена в окрестности точки $a = (a_1, \dots, a_m)$, причем $a_j = \varphi_j(t^0)$, $j = 1, \dots, m$. $F(t) = f(\varphi_1(t), \dots, \varphi_m(t))$ – суперпозиция функций f и функций $\varphi_1(t) \dots$ (сложная функция)

Теорема 3 [О дифференцируемости сложной функции]:

Пусть функции φ_j , $j = 1, \dots, m$ дифференцируемы в точке t^0 , функция f дифференцируема в точке a , причем $a_j = \varphi_j(t^0)$, $j = 1, \dots, m$. Тогда $F(t) = f(\varphi_1(t), \dots, \varphi_m(t))$ дифференцируема в точке t^0 и

$$\frac{\partial F}{\partial t_j}(t^0) = \frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \frac{\partial \varphi_1}{\partial t_j}(t^0) + \frac{\partial f}{\partial x_2}(a) \frac{\partial \varphi_2}{\partial t_j}(t^0) + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \frac{\partial \varphi_m}{\partial t_j}(t^0), j = 1, \dots, k$$

Доказательство. $t^0 + \Delta t \in \mathcal{U}(t^0)$, $a + \Delta x \in \mathcal{U}(a)$, $\rho = \sqrt{(\Delta t_1)^2 + \dots + (\Delta t_k)^2}$.

Условия дифференцируемости функции φ_j в точке t^0 :

$$\Delta \varphi_j(t^0, \Delta t) = \frac{\partial \varphi_j}{\partial t_1}(t^0) \Delta t_1 + \dots + \frac{\partial \varphi_j}{\partial t_k}(t^0) \Delta t_k + o(\rho), \rho \rightarrow 0; \rho \rightarrow 0 \Leftrightarrow \Delta t \rightarrow \bar{0}.$$

Условия дифференцируемости функции f в точке a :

$$\Delta f(a, \Delta x) = \frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \Delta x_1 + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \Delta x_m + \alpha_1 \Delta x_1 + \dots + \alpha_m \Delta x_m.$$

Подставим вместо $\Delta x_1 \dots \Delta x_m$ приращения функции φ :

$$\begin{aligned} \Delta f(a, \Delta x) &= \frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \left[\frac{\partial \varphi_1}{\partial t_1}(t^0) \Delta t_1 + \dots + \frac{\partial \varphi_1}{\partial t_k}(t^0) \Delta t_k + o(\rho) \right] + \dots \\ &\quad \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \left[\frac{\partial \varphi_m}{\partial t_1}(t^0) \Delta t_1 + \dots + \frac{\partial \varphi_m}{\partial t_k}(t^0) \Delta t_k + o(\rho) \right] + \\ &\quad + \alpha_1 \left[\frac{\partial \varphi_1}{\partial t_1}(t^0) \Delta t_1 + \dots + \frac{\partial \varphi_1}{\partial t_k}(t^0) \Delta t_k + o(\rho) \right] + \dots \\ &\quad \dots + \alpha_m \left[\frac{\partial \varphi_m}{\partial t_1}(t^0) \Delta t_1 + \dots + \frac{\partial \varphi_m}{\partial t_k}(t^0) \Delta t_k + o(\rho) \right]. \end{aligned}$$

Перегруппируем слагаемые:

$$\begin{aligned} &\left[\frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \frac{\partial \varphi_1}{\partial t_1}(t_0) + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \frac{\partial \varphi_m}{\partial t_1}(t_0) \right] \Delta t_1 + \dots \\ &\quad \dots + \left[\frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \frac{\partial \varphi_1}{\partial t_k}(t_0) + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \frac{\partial \varphi_m}{\partial t_k}(t_0) \right] \Delta t_k + \\ &\quad + o(\rho) \left[\frac{\partial f}{\partial x_1}(a) + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) + \alpha_1 + \dots + \alpha_m \right] + \\ &\quad + \rho \left[\alpha_1 \frac{\partial \varphi_1}{\partial t_1}(t^0) + \dots + \alpha_m \frac{\partial \varphi_m}{\partial t_1}(t^0) \right] \frac{\Delta t_1}{\rho} + \dots \\ &\quad \dots + \rho \left[\alpha_1 \frac{\partial \varphi_1}{\partial t_k}(t^0) + \dots + \alpha_m \frac{\partial \varphi_m}{\partial t_k}(t^0) \right] \frac{\Delta t_k}{\rho}. \end{aligned}$$

$$\Delta F(t^0, \Delta t) = \frac{\partial F}{\partial t_1}(t^0) \Delta t_1 + \dots + \frac{\partial F}{\partial t_k}(t^0) \Delta t_k + o(\rho) \gamma + \rho \Lambda_1 + \dots + \rho \Lambda_k$$

γ - ограничена, $\Delta x_j = \Delta \varphi_j \xrightarrow{\Delta t \rightarrow \bar{0}} 0$, $\rho \rightarrow 0 \Leftrightarrow \Delta t \rightarrow \bar{0} = (0, \dots, 0)$. $\Rightarrow \alpha_j \rightarrow 0$, при $\rho \rightarrow 0$

$$\Lambda_j = [\alpha_1 \frac{\partial \varphi_1}{\partial t_1}(t^0) + \dots + \alpha_m \frac{\partial \varphi_m}{\partial t_1}(t^0)] \frac{\Delta t_j}{\rho} \rightarrow 0, \rho \rightarrow 0$$

Перепишем:

$$\Delta F(t^0, \Delta t) = \frac{\partial F}{\partial t_1}(t^0) \Delta t_1 + \dots + \frac{\partial F}{\partial t_k}(t^0) \Delta t_k + o(\rho), \rho \rightarrow 0$$

Доказано.

3.5. Дифференциал. Инвариантность формы дифференциала относительно замены переменных.

Рассматриваем функцию $w = f(x)$ определенную в $\mathcal{U}(a) \subset \mathbb{E}^m$. Мы предполагаем, что f дифференцируема в точке a . Поскольку функция дифференцируема в точке a , то

$$\Delta f(a, \Delta x) = \frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \Delta x_1 + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \Delta x_m + o(\rho), \rho \rightarrow 0$$

Определение: Дифференциалом функции f в точке a называется главная линейная часть (относительно Δx_j) приращения функции f в точке a , соответствующая приращению аргументов $\Delta x = (\Delta x_1, \dots, \Delta x_n)$.

$$df(a) = \frac{\partial f}{\partial x_1}(a)\Delta x_1 + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a)\Delta x_m$$

Поскольку дифференциал независимой переменной x_j есть произвольное число, то $dx_j = \Delta x_j$.

$$df(a) = \frac{\partial f}{\partial x_1}(a)dx_1 + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a)dx_m \quad (*)$$

Предложение. [Инвариантность формы 1-го дифференциала]

Выражение (*) универсально, оно справедливо и в случае, когда $x_j = \varphi_j(t)$, $t \in \mathcal{U}(t^0) \subset \mathbb{E}^k$, $a_j = \varphi_j(t^0)$, $j = 1, \dots, m$ (φ_j дифференцируема в точке t^0).

Доказательство.

$$d\varphi_j(t^0) = \frac{\partial \varphi_j}{\partial t_1}(t^0)dt_1 + \dots + \frac{\partial \varphi_j}{\partial t_k}(t^0)dt_k, \quad j = 1, \dots, m$$

Введем функцию $F(t) = f(\varphi_1(t), \dots, \varphi_m(t))$

$$\begin{aligned} dF(t^0) &= \frac{\partial F}{\partial t_1}(t^0)dt_1 + \dots + \frac{\partial F}{\partial t_k}(t^0)dt_k \\ dF(t^0) &= \left[\frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \frac{\partial \varphi_1}{\partial t_1}(t^0) + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \frac{\partial \varphi_m}{\partial t_1}(t^0) \right] dt_1 + \dots \\ &+ \left[\frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \frac{\partial \varphi_1}{\partial t_k}(t^0) + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \frac{\partial \varphi_m}{\partial t_k}(t^0) \right] dt_k \end{aligned}$$

Перегруппируем:

$$\begin{aligned} dF(t^0) &= \frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \left[\frac{\partial \varphi_1}{\partial t_1}(t^0)dt_1 + \dots + \frac{\partial \varphi_1}{\partial t_k}(t^0)dt_k \right] + \dots \\ &+ \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \left[\frac{\partial \varphi_m}{\partial t_1}(t^0)dt_1 + \dots + \frac{\partial \varphi_m}{\partial t_k}(t^0)dt_k \right] \end{aligned}$$

Получаем:

$$dF(t^0) = \frac{\partial f}{\partial x_1}(a)dx_1 + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a)dx_m$$

Доказано.

3.6. Производная по направлению и градиент, их связь и геометрический смысл.

Рассматриваем функцию $w = f(x)$ определенную в $\mathcal{U}(a) \subset \mathbb{E}^m$. Мы предполагаем, что f дифференцируема в точке a . Возьмём единичный вектор $\vec{n} = (\cos \alpha_1, \dots, \cos \alpha_m)$, $|\vec{n}| = 1$.

$$l : \begin{cases} x_1 = a_1 + t \cos \alpha_1; \\ \dots \\ \dots \\ \dots \\ x_m = a_m + t \cos \alpha_m; \end{cases}$$

Рассмотрим суперпозицию:

$$F(t) = f(a_1 + t \cos \alpha_1, \dots, a_m + t \cos \alpha_m)$$

F дифференцируема в точке $t = 0$.

Определение: Производной функции f по направлению l в точке $x = a$ называется производная функции F в точке $t = 0$.

Обозначения.

$$\frac{\partial f}{\partial l}(a) = \lim_{t \rightarrow 0} \frac{f(a_1 + t \cos \alpha_1, \dots, a_m + t \cos \alpha_m) - f(a)}{t}$$

$$\frac{\partial f}{\partial l}(a) = \frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \cos \alpha_1 + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \cos \alpha_m$$

Определение: Градиентом функции f называется вектор

$$\text{grad} f(a) = \left(\frac{\partial f}{\partial x_1}(a), \dots, \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \right)$$

Из этого определения и выражения для производной по направлению l в точке a функции f мы получаем:

$$\frac{\partial f}{\partial l}(a) = (\text{grad} f(a), \vec{n})$$

Предложение. Градиент функции f в точке a характеризует направление и величину максимального роста производной по направлению функции f в точке a .

Доказательство.

По определению производной по направлению в точке a :

$$\frac{\partial f}{\partial l}(a) = |\text{grad} f(a)| |\vec{n}| \cos \varphi = |\text{grad} f(a)| \cos \varphi$$

$\cos \varphi$ имеет наибольшее значение равное 1 $\Rightarrow \cos \varphi = 1 \Rightarrow \vec{n}$ и grad — направление совпадают, т.к. в этом случае $\varphi = 0$.

Доказано.

3.7. Необходимые условия дифференцируемости

Необходимое условие 1.

$$[f \text{ дифференцируема в точке } a] \Rightarrow [\exists \frac{\partial f}{\partial x_j}(a), j = 1, \dots, m]$$

Доказательство.

Возьмем $j = k$, рассматриваем $\Delta x = (0, \dots, 0, \Delta x_k, 0, \dots, 0)$. Тогда $\Delta f(a, \Delta x) = \Delta_k f(a, \Delta x_k)$. Тогда используя 1-ое условие определения получим:

$$\Delta f(a, \Delta x) = A_1 \Delta x_1 + \dots + A_m \Delta x_m + \alpha_1(\Delta x) \Delta x_1 + \dots + \alpha_m(\Delta x) \Delta x_m$$

Получаем следующее:

$$\Delta_k f(a, \Delta x_k) = A_k \Delta x_k + \alpha_k \Delta x_k$$

$$\frac{\Delta_k f(a, \Delta x_k)}{\Delta x_k} = A_k + \alpha_k \rightarrow A_k, \Delta x_k \rightarrow 0 \Rightarrow A_k = \frac{\partial f}{\partial x_k}(a)$$

В силу произвольности мы доказано для всех переменных.

Доказано.

Таким образом мы уточнили определение, например, перепишем определение 1:

$$\Delta f(a, \Delta x) = \frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \Delta x_1 + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \Delta x_m + \alpha_1(\Delta x) \Delta x_1 + \dots + \alpha_m(\Delta x) \Delta x_m$$

Необходимое условие 2. Если $w = f(x), x \in \mathbb{E}^m$ дифференцируема в точке a , то f непрерывна в точке a .

Доказательство.

$\Delta f(a, \Delta x) = f(a + \Delta x) - f(a) = \frac{\partial f}{\partial x_1}(a) \Delta x_1 + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_m}(a) \Delta x_m + \alpha_1(\Delta x) \Delta x_1 + \dots + \alpha_m(\Delta x) \Delta x_m$.
Если $\Delta x \rightarrow \bar{0}$, то $f(a + \Delta x) - f(a) \rightarrow 0 \Rightarrow f$ непрерывна в точке a .

Доказано.

Необходимое условие 3. (Не было в лекции Знаменской)

Пусть функция f дифференцируема в точке (x_0, y_0, z_0) . Тогда в этой точке функция f имеет производную по любому направлению и эта производная находится по формуле

$$\frac{\partial f}{\partial l}(x_0, y_0, z_0) = \frac{\partial f}{\partial x} \cos \alpha + \frac{\partial f}{\partial y} \cos \beta + \frac{\partial f}{\partial z} \cos \gamma$$

[Взято из Кудрявцева, Том 2, стр. 267]

4. Билет 4

4.1. Частные производные высших порядков.

Определение: Пусть $\omega = f(x)$ - дифференцируема в $D \subset \mathbb{E}^m$, D - область. И $\forall x \in D \exists \frac{\partial f}{\partial x_j}, j = \overline{1, m}$.

Пусть $g_j = \frac{\partial f}{\partial x_j}$, и в точке $x \exists \frac{\partial g_j}{\partial x_k}$. Тогда

$$\frac{\partial g_j}{\partial x_k} = \frac{\partial}{\partial x_k} \left(\frac{\partial f}{\partial x_j} \right)$$

называется частной производной 2-го порядка функции f в точке x . Частные производные высших порядков определяются так же.

Обозначения:

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x_k \partial x_j}(x), \quad f''_{x_j x_k}(x), \quad f_{x_j x_k}^{(2)}(x)$$

$$j = k : \frac{\partial^2 f}{\partial x_j^2}(x)$$

Примечание: если $k \neq j$, производная $\frac{\partial^2 f}{\partial x_k \partial x_j}$ называется смешанной.

4.2. Независимость смешанной частной производной от порядка дифференцирования.

Примеры:

1.

$$\begin{aligned} f(x, y) &= \operatorname{arctg} \left(\frac{x}{y} \right) \\ \frac{\partial f}{\partial x} &= \frac{1}{1 + \frac{x^2}{y^2}} \cdot \frac{1}{y} = \frac{y}{y^2 + x^2} \\ \frac{\partial f}{\partial y} &= \frac{1}{1 + \frac{x^2}{y^2}} \cdot \left(-\frac{x}{y^2} \right) = -\frac{x}{y^2 + x^2} \\ \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x} &= \frac{y^2 + x^2 - 2y^2}{(x^2 + y^2)^2} = \frac{x^2 - y^2}{(x^2 + y^2)^2} \\ \frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y} &= -\frac{y^2 + x^2 - 2x^2}{(x^2 + y^2)^2} = \frac{x^2 - y^2}{(x^2 + y^2)^2} \\ \frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y} &= \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x} \end{aligned}$$

2.

$$f(x, y) = \begin{cases} xy \cdot \frac{x^2 - y^2}{x^2 + y^2}, & x^2 + y^2 \neq 0 \\ 0, & x^2 + y^2 = 0 \end{cases}$$

$$f(x, 0) = f(0, y) = f(0, 0) = 0 \Rightarrow \frac{\partial f}{\partial x}(0, 0) = \frac{\partial f}{\partial y}(0, 0) = 0$$

$$f'_x = y \frac{x^2 - y^2}{x^2 + y^2} + xy \frac{2x(x^2 + y^2) - 2x(x^2 - y^2)}{(x^2 + y^2)^2} = \frac{y(x^4 - y^4) + 4x^2y^3}{(x^2 + y^2)^2}$$

$$f'_y = x \frac{x^2 - y^2}{x^2 + y^2} + xy \frac{-2y(x^2 + y^2) - 2y(x^2 - y^2)}{(x^2 + y^2)^2} = \frac{x(x^4 - y^4) + 4x^3y^2}{(x^2 + y^2)^2}$$

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x, y) = \begin{cases} \frac{yx^4 - y^5 + 4x^2y^3}{(x^2 + y^2)^2}, & x^2 + y^2 \neq 0 \\ 0, & x^2 + y^2 = 0 \end{cases}$$

$$\frac{\partial f}{\partial y}(x, y) = \begin{cases} \frac{x^5 - xy^4 - 4x^3y^2}{(x^2 + y^2)^2}, & x^2 + y^2 \neq 0 \\ 0, & x^2 + y^2 = 0 \end{cases}$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}(0, 0) = \lim_{y \rightarrow 0} \frac{f'_x(0, y) - f'_x(0, 0)}{y} = \lim_{y \rightarrow 0} \frac{-y^5}{y^5} = -1$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}(0, 0) = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{f'_y(x, 0) - f'_y(0, 0)}{x} = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{x^5}{x^5} = 1$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y} \neq \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}$$

Из этих примеров видно, что в общем случае смешанные производные зависят от порядка дифференцирования.

Теорема: Пусть в $\mathcal{U}(a) \subset \mathbb{E}^2$ определены $\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}$ и $\frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}$, и эти производные непрерывны в точке $a = (a_1, a_2)$, тогда

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}(a) = \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}(a)$$

Доказательство: Рассмотрим функцию

$$U(x, y) = f(x, y) - f(x, a_2) - f(a_1, y) + f(a_1, a_2)$$

Пусть $\Pi = \{(x, y) : |x - a_1| \leq r_1, |y - a_2| \leq r_2\}$, $\Pi \subset \mathcal{U}(a)$, где определены смешанные производные. Фиксируем $y \in (a_2 - r_2, a_2 + r_2)$ и на интервале $(a_1 - r_1, a_1 + r_1)$ Рассмотрим функцию

$$\varphi(x) = f(x, y) - f(x, a_2)$$

φ дифференцируема на интервале $(a_1 - r_1, a_1 + r_1)$ и $U(x, y) = \varphi(x) - \varphi(a_1)$. Тогда, по теореме Лагранжа $\exists \Theta_1 : 0 < \Theta_1 < 1$:

$$U(x, y) = \varphi'(a_1 + \Theta_1 \Delta x) \Delta x$$

где $\Delta x = x - a_1$

$$U(x, y) = [f'_x(a_1 + \Theta_1 \Delta x, y) - f'_x(a_1 + \Theta_1 \Delta x, a_2)] \Delta x$$

К выражению, стоящему в [...] применим теорему Лагранжа.

$\exists \Theta_2 : 0 < \Theta_2 < 1$:

$$U(x, y) = f''_{xy}(a_1 + \Theta_1 \Delta x, a_2 + \Theta_2 \Delta y) \Delta y \Delta x$$

где $\Delta y = y - a_2$.

Аналогично фиксируем $x \in (a_1 - r_1, a_1 + r_1)$ и на интервале $(a_2 - r_2, a_2 + r_2)$ получаем

$$U(x, y) = f''_{yx}(a_1 + \Theta_3 \Delta x, a_2 + \Theta_4 \Delta y) \Delta y \Delta x$$

$$f''_{yx}(a_1 + \Theta_3 \Delta x, a_2 + \Theta_4 \Delta y) = f''_{xy}(a_1 + \Theta_1 \Delta x, a_2 + \Theta_2 \Delta y)$$

Учитывая непрерывность в точке a при $\Delta x \rightarrow 0, \Delta y \rightarrow 0$, получаем $f''_{xy}(a) = f''_{yx}(a)$.

Определение: Функция $\omega = f(x, y)$ называется n раз дифференцируемой в точке $x = a \in (E)^m$, если все ее частные производные порядка $n - 1$ есть дифференцируемые функции

Теорема: (без доказательства) Пусть $\omega = f(x, y)$ дважды дифференцируема в точке a , тогда

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}(a) = \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}(a)$$

4.3. Дифференциалы высших порядков. Отсутствие инвариантности их формы.

Определение: Пусть $\omega = f(x)$ дважды дифференцируема в $D \subset \mathbb{E}^m$. $\forall x \in D$ $df(x) = \sum_{j=1}^m \frac{\partial f}{\partial x_j}(x) dx_j$. Тогда дифференциалом 2 порядка будем называть

$$d^2 f(x) = d(df)(x) = \sum_{j=1}^m d \left(\frac{\partial f}{\partial x_j} \right) (x) dx_j = \sum_{j=1}^m \left(\sum_{k=1}^m \frac{\partial^2 f}{\partial x_k \partial x_j}(x) dx_k \right) dx_j$$

Дифференциалы высших порядков определяются таким же образом.

Замечание: Если рассмотреть дифференциал, как оператор

$$d = \left(dx_1 \frac{\partial}{\partial x_1} + \dots + dx_m \frac{\partial}{\partial x_m} \right)$$

То дифференциал n -ого порядка можно записать в виде

$$d^n = \left(dx_1 \frac{\partial}{\partial x_1} + \dots + dx_m \frac{\partial}{\partial x_m} \right)^n$$

Предложение: Дифференциалы высших порядков не обладают свойством инвариантности формы.

Доказательство: Пусть $\omega = f(x)$, $x_j = \varphi_j(t)$, $j = \overline{1, m}$, f, φ_j - дважды дифференцируемы.

$$df(x) = \sum_{j=1}^m \frac{\partial f}{\partial x_j}(x) dx_j, \quad dx_j = \sum_{i=1}^m \frac{\partial \varphi_j}{\partial t_i}(t) dt_i$$

$$d^2 f(x) = \sum_{k=1}^m \sum_{j=1}^m \frac{\partial^2 f}{\partial x_k \partial x_j}(x) dx_k dx_j + \sum_{j=1}^m \frac{\partial f}{\partial x_j}(x) d^2 x_j$$

причем

$$\sum_{j=1}^m \frac{\partial f}{\partial x_j}(x) d^2 x_j \neq 0$$

4.4. Формула Тейлора для функций нескольких переменных.

Теорема [Разложение с остаточным членом в форме Лагранжа]: Пусть функция $\omega = f(x)$ обладает непрерывными частными производными порядка $n+1$ в шаре $B_\delta(a)$, Δx таково, что $a + \Delta x \in B_\delta(a)$. Тогда найдется $0 < \theta < 1$ такое, что

$$f(a + \Delta x) = f(a) + \sum_{j=1}^n \frac{d^j f}{j!}(a) + r_{n+1}(\theta)$$

где

$$r_{n+1}(\theta) = \frac{d^{n+1} f(a + \theta \Delta x)}{(n+1)!}$$

Примечание: dx_j трактуется как Δx_j

Доказательство: $a + \Delta x \in B_\delta(a) \Rightarrow a - \Delta x \in B_\delta(a), \forall t \in [-1, 1], a + t\Delta x \in B_\delta(a)$.

$$f(a + t\Delta x) = f(a_1 + t\Delta x_1, \dots, a_m + t\Delta x_m) = \varphi(t)$$

$$\varphi(0) = f(a)$$

$$\varphi'(t) = \sum_{j=1}^m \frac{\partial f}{\partial x_j}(a + t\Delta x_j) \Delta x_j = df(a + t\Delta x)$$

$$\varphi^{(k)}(t) = \sum_{j_k=1}^m \dots \sum_{j_1=1}^m \frac{\partial^k f}{\partial x_{j_k} \dots \partial x_{j_1}} \Delta x_{j_1} \dots \Delta x_{j_k} = d^k f(a + t\Delta x)$$

По формуле Тейлора

$$\varphi(t) = \varphi(0) + \sum_{k=1}^n \frac{\varphi^{(k)}(0)}{k!} t^k + r_{n+1}(\theta)$$

где

$$r_{n+1}(\theta) = \frac{\varphi^{(n+1)}(\theta t)}{(n+1)!} t^{(n+1)}$$

Подставив $t = 1$ получим требуемое равенство.

Теорема [Разложение с остаточным членом в форме Пеано]: (без доказательства)
Пусть f n -раз дифференцируема в точке $x = a$, тогда

$$f(a + \Delta x) = f(a) + \sum_{k=1}^n \frac{d^k f}{k!}(a) + o(\rho), \rho \rightarrow 0, \rho(\Delta x, 0)$$

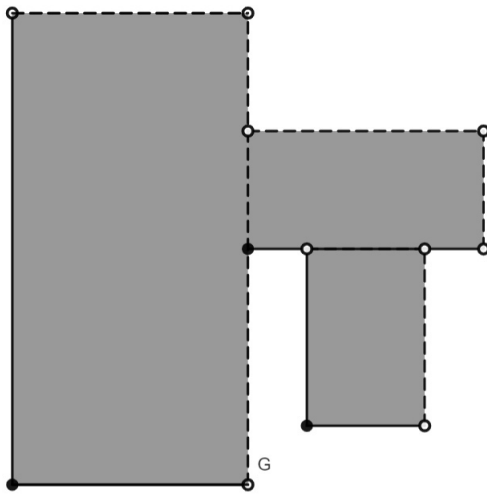
5. Билет 5

5.1. Необходимые определения и предложения билета.

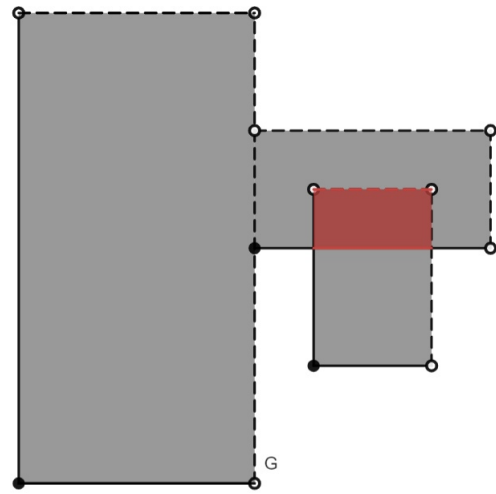
Определение: множество $Q = [a_1, b_1) \times [a_2, b_2) \times \cdots \times [a_m, b_m)$ будем называть клеткой в \mathbb{E}^m .

Определение: множество $G \subset \mathbb{E}^m$ будем называть клеточным, если оно является объединением **конечного** числа попарно непересекающихся клеток:

$$G = \bigcup_{j=1}^k Q_j, \quad Q_i \cap Q_j = \emptyset, \quad i \neq j.$$



G - клеточное множество



G - не клеточное множество

Свойства клеточных множеств:

1° Объединение **конечного** числа попарно непересекающихся клеточных множеств есть клеточное множество.

Доказательство:

G и H - клеточные множества. Тогда:

$$G = \bigcup_{j=1}^k Q_j, \quad H = \bigcup_{j=k+1}^n Q_j.$$

Значит:

$$G \cup H = \bigcup_{j=1}^n Q_j - \text{клеточное множество.}$$

2° Пересечение двух клеток есть клетка.

Доказательство:

Пусть $Q_1 = [a_1, b_1) \times [a_2, b_2) \times \cdots \times [a_m, b_m)$, а $Q_2 = [c_1, d_1) \times [c_2, d_2) \times \cdots \times [c_m, d_m)$. Тогда возможны два случая:

- а) $\exists j: [a_j, b_j) \cap [c_j, d_j) = \emptyset \Rightarrow Q_1 \cap Q_2 = \emptyset$ - клетка;
- б) $\forall j \mapsto [a_j, b_j) \cap [c_j, d_j) = [e_j, f_j) \Rightarrow Q_1 \cap Q_2 = [e_1, f_1) \times [e_2, f_2) \times \cdots \times [e_m, f_m)$ - клетка.

3° Пересечение двух клеточных множеств есть клеточное множество.

Доказательство:

Пусть G_1 и G_2 - клеточные множества.

$$G_1 = Q_1^1 \cup Q_2^1 \cup \dots \cup Q_k^1$$

$$G_2 = Q_1^2 \cup Q_2^2 \cup \dots \cup Q_n^2$$

Обозначим $Q_{ij} = Q_i^1 \cap Q_j^2$, $i = \overline{1, k}$, $j = \overline{1, n}$.

Q_{ij} - клетка (свойство 2°).

$G_1 \cap G_2 = \bigcup_{i,j} Q_{ij} = \bigcup_{i=1}^k \bigcup_{j=1}^n Q_{ij}$ - объединение попарно непересекающихся клеток есть клеточное множество.

4° Разность двух клеток есть клеточное множество.

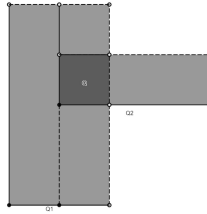
Доказательство:

Q_1 и Q_2 - клетки. $Q = Q_1 \cap Q_2$ - клетка (свойство 2°). Тогда

$$Q_1 \setminus Q_2 = Q_1 \setminus Q.$$

Существует такое разбиение клетки Q_1 на более мелкие клетки, что Q является одной из них \Rightarrow

$\Rightarrow Q_1 \setminus Q_2$ - клеточное множество.



5° Разность двух клеточных множеств есть клеточное множество.

Доказательство:

$$G_1 = \bigcup_{j=1}^k Q_j^1, \quad G_2 = \bigcup_{j=1}^n Q_j^2.$$

$$G_1 \setminus Q_1^2 = \bigcup_{i=1}^k (Q_i^1 \setminus Q_1^2) = \bigcup_{i=1}^k G_{i1}$$

G_{i1} - клеточное множество (свойство 4°).

$G_{i1} \cap G_{j1} = \emptyset$, если $i \neq j \Rightarrow$

$\Rightarrow G_1 \setminus Q_1^2$ - клеточное множество (свойство 1°).

$$G_1 \setminus G_2 = G_1 \setminus \left(\bigcup_{j=1}^n Q_j^2 \right) = \bigcap_{j=1}^n (G_1 \setminus Q_j^2) = \bigcap_{j=1}^n \left(\bigcup_{i=1}^k G_{ij} \right)$$

Последнее является клеточным множеством, так как $G_{ij} \cap G_{sl} = \emptyset$, если $i \neq s$ или $j \neq l$. Откуда получаем, что $G_1 \setminus G_2$ - клеточное множество.

6° Объединение **конечного** числа клеточных множеств есть клеточное множество.

Доказательство:

1) G_1 и G_2 .

$$G_1 \cup G_2 = (G_1 \setminus G_2) \cup (G_2 \setminus G_1) \cup (G_1 \cap G_2);$$

Последние три скобки являются попарно непересекающимися клеточными множествами $\xRightarrow{1^\circ} G_1 \cup G_2$ - клеточное множество.

2) Далее для G_3, G_4, \dots, G_n по индукции.

Таким образом, объединение, пересечение и разность конечного числа клеточных множеств есть клеточное множество.

Определение: мерой клетки Q назовем число:

$$m(Q) = (b_1 - a_1) \cdot (b_2 - a_2) \cdot \dots \cdot (b_m - a_m);$$

$$m(\emptyset) = 0.$$

Определение: мерой клеточного множества G назовем число:

$$m(G) = \sum_{j=1}^k m(Q_j); \quad m(\emptyset) = 0.$$

Лемма: мера клеточного множества G не зависит от способа разбиения этого множества на клетки.

Доказательство:

Пусть $G = Q_1 \cup Q_2 \cup \dots \cup Q_k$ и также $G = Q'_1 \cup Q'_2 \cup \dots \cup Q'_n$. Тогда обозначим $Q_{ij} = Q_i \cap Q'_j$, $i = \overline{1, k}$, $j = \overline{1, n}$.

Понятно, что

$$Q_i = \bigcup_{j=1}^n Q_{ij}, \quad Q'_j = \bigcup_{i=1}^k Q_{ij}.$$

Тогда:

$$m(G) = \sum_{i=1}^k m(Q_i) = \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^n m(Q_{ij}) = \sum_{j=1}^n \sum_{i=1}^k m(Q_{ij}) = \sum_{j=1}^n m(Q'_j) = m(G).$$

Предложение 1: если клеточные множества G_1, G_2, \dots, G_n попарно не пересекаются, то для $G = \bigcup_{j=1}^n G_j$ выполняется $m(G) = \sum_{j=1}^n m(G_j)$.

Доказательство:

$$G_j = \bigcup_{i=1}^{k_j} Q_i^j, \quad j = \overline{1, n}.$$

Тогда

$$G = \bigcup_{j=1}^n G_j = \bigcup_{j=1}^n \bigcup_{i=1}^{k_j} Q_i^j = \bigcup_{\substack{1 \leq j \leq n, \\ 1 \leq i \leq k_j}} Q_i^j$$

Все клетки из последнего объединения попарно не пересекаются, поэтому:

$$m(G) = \sum_{\substack{1 \leq j \leq n, \\ 1 \leq i \leq k_j}} m(Q_i^j) = \sum_{j=1}^n m(G_j).$$

Предложение 2: если G_1 и G_2 - клеточные множества и $G_1 \subset G_2$, то $m(G_2) = m(G_1) + m(G_2 \setminus G_1)$, $m(G_1) \leq m(G_2)$.

Доказательство:

$$G_2 = G_1 \cup (G_2 \setminus G_1) = G_1 \cup G.$$

$$G_1 \cap G = \emptyset \xrightarrow{\text{np.1}} m(G_2) = m(G_1) + m(G_2 \setminus G_1) \Rightarrow m(G_1) \leq m(G_2).$$

Предложение 3: если G_1, G_2, \dots, G_k - клеточные множества, $G = \bigcup_{j=1}^k G_j$, то $m(G) \leq$

$$\sum_{j=1}^k m(G_j).$$

Доказательство:

Для G_1 и G_2 по предложению 2, а далее по индукции.

Предложение 4: для любого клеточного множества G и $\forall \varepsilon > 0 \exists G_\varepsilon, G^\varepsilon$ - клеточные множества такие, что:

- 1) $G_\varepsilon \subset \overline{G_\varepsilon} \subset \text{int } G \subset G$; $m(G) - m(G_\varepsilon) < \varepsilon$;
- 2) $G \subset \overline{G} \subset \text{int } G^\varepsilon \subset G^\varepsilon$; $m(G^\varepsilon) - m(G) < \varepsilon$.

Доказательство:

- 1) $G = Q_1 \cup Q_2 \cup \dots \cup Q_k$.

Рассмотрим отдельную клетку $Q = [a_1, b_1) \times [a_2, b_2) \times \dots \times [a_m, b_m)$

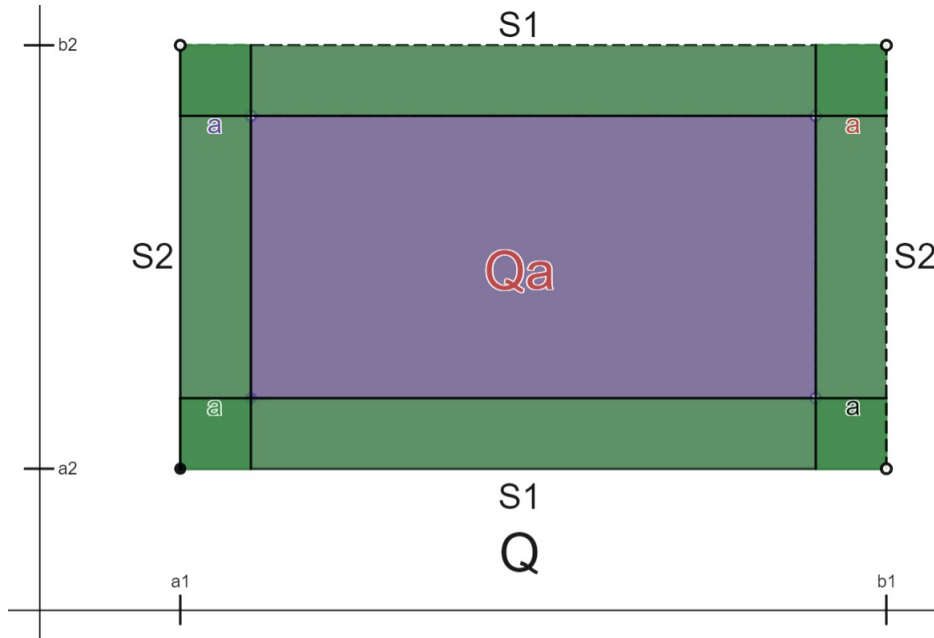


Рис. 2: Случай при $m = 2$

$$m(Q_a) = \prod_{j=1}^m (b_j - a_j - 2a), \quad Q_a \subset Q$$

$$S_j = \prod_{\substack{i=1, \\ i \neq j}}^m (b_i - a_i);$$

Тогда

$$m(Q) < m(Q_a) + 2a \cdot \sum_{j=1}^m S_j = m(Q_a) + 2aS \Rightarrow m(Q) - m(Q_a) < 2aS = \varepsilon$$

Тогда для одной клетки $a = \frac{\varepsilon}{2S}$.

Так как $G = Q_1 \cup Q_2 \cup \dots \cup Q_k$, то $a = \frac{\varepsilon}{2S_k}$.

Получаем $G_\varepsilon = \bigcup_{i=1}^k (Q_a)_i$.

Таким образом, $G_\varepsilon \subset \overline{G_\varepsilon} \subset \text{int } G \subset G$.

2) Доказывается аналогично 1).

5.2. Определение измеримости по Жордану множества в m -мерном евклидовом пространстве.

Определение: множество $X \subset \mathbb{E}^m$ называется измеримым по Жордану, если $\forall \varepsilon > 0 \exists G_\varepsilon$ и G^ε - клеточные множества такие, что $G_\varepsilon \subset X \subset G^\varepsilon$ и $m(G^\varepsilon) - m(G_\varepsilon) < \varepsilon$.

Определение: мерой измеримого по Жордану множества $X \subset \mathbb{E}^m$ называется такое число $m(X)$, что $\forall G_\varepsilon, G^\varepsilon$ таких, что $G_\varepsilon \subset X \subset G^\varepsilon \mapsto m(G_\varepsilon) \leq m(X) \leq m(G^\varepsilon)$.

Лемма: для любого измеримого по Жордану множества X его мера $m(X)$ существует и единственна, причем

$$m(X) = \overline{m}(X) = \underline{m}(X),$$

где $\overline{m}(X) = \inf_{X \subset G^\varepsilon} m(G^\varepsilon)$ - верхняя (внешняя) мера X ;
 $\underline{m}(X) = \sup_{G_\varepsilon \subset X} m(G_\varepsilon)$ - нижняя (внутренняя) мера X .

Доказательство:

Так как $G_\varepsilon \subset X \subset G^\varepsilon$, то $m(G_\varepsilon) \leq m(G^\varepsilon) \Rightarrow \{m(G_\varepsilon)\}$ ограничена сверху $\Rightarrow \Rightarrow \exists \beta = \sup_{G_\varepsilon} m(G_\varepsilon) = \underline{m}(X)$.

Аналогично: $\{m(G^\varepsilon)\}$ ограничена снизу $\Rightarrow \exists \alpha = \inf_{G^\varepsilon} m(G^\varepsilon) = \overline{m}(X)$.

По теореме об отделимости множеств: $m(G_\varepsilon) \leq \alpha \leq \beta \leq m(G^\varepsilon)$.

Пусть $m(X) = \alpha$.

$\forall \varepsilon > 0 \mapsto 0 \leq \beta - \alpha \leq m(G^\varepsilon) - m(G_\varepsilon) < \varepsilon$.

Откуда $\beta = \alpha \Rightarrow m(X)$ единственна.

Предложение 5: пусть множество X измеримо по Жордану и $\forall \varepsilon > 0 \exists G^\varepsilon: X \subset G^\varepsilon, m(G^\varepsilon) < \varepsilon$. Тогда $m(X) = 0$.

Доказательство:

Возьмем $G_\varepsilon = \emptyset$. Тогда:

$\forall \varepsilon > 0 \mapsto G_\varepsilon \subset X \subset G^\varepsilon \ \& \ m(G^\varepsilon) - m(G_\varepsilon) = m(G^\varepsilon) < \varepsilon \Rightarrow \Rightarrow 0 \leq m(X) < \varepsilon \Rightarrow m(X) = 0$.

Замечание: измеримое по Жордану множество, обладающее свойством из предыдущего предложения, будем называть множеством меры нуль.

Предложение 6: подмножество множества меры нуль есть множество меры нуль.

Доказательство:

Пусть $m(X) = 0$ и $Y \subset X$. Тогда $\forall \varepsilon > 0 \exists G^\varepsilon: X \subset G^\varepsilon, m(G^\varepsilon) < \varepsilon$.

Как следствие:

$\forall \varepsilon > 0 \exists G^\varepsilon: Y \subset X \subset G^\varepsilon, m(G^\varepsilon) < \varepsilon \Rightarrow m(Y) = 0$.

Предложение 7: объединение конечного числа множеств меры нуль есть множество меры нуль.

Доказательство:

$$m(X_1) = m(X_2) = 0.$$

$$\forall \varepsilon > 0 \exists G_1^\varepsilon : X_1 \subset G_1^\varepsilon, m(G_1^\varepsilon) < \frac{\varepsilon}{2};$$

$$\exists G_2^\varepsilon : X_2 \subset G_2^\varepsilon, m(G_2^\varepsilon) < \frac{\varepsilon}{2}.$$

$$\text{Тогда } X_1 \cup X_2 \subset G_1^\varepsilon \cup G_2^\varepsilon = G^\varepsilon.$$

$$m(G^\varepsilon) \stackrel{\text{пр.3}}{\leq} m(G_1^\varepsilon) + m(G_2^\varepsilon) < \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon}{2} = \varepsilon \Rightarrow m(X_1 \cup X_2) = 0.$$

Далее по индукции.

5.3. Критерий измеримости.

Теорема [Критерий измеримости]:

$$[X - \text{измеримо по Жордану}] \iff [X \text{ ограничено и } m(\partial X) = 0].$$

Доказательство:

\implies :

$$X - \text{измеримо по Жордану: } \forall \varepsilon > 0 \exists G_\varepsilon, G^\varepsilon : G_\varepsilon \subset X \subset G^\varepsilon,$$

$$m(G^\varepsilon) - m(G_\varepsilon) < \frac{\varepsilon}{3};$$

$$\text{Из предложения 4 } \Rightarrow \exists \widetilde{G}^\varepsilon : \overline{G^\varepsilon} \subset \text{int } \widetilde{G}^\varepsilon \subset \widetilde{G}^\varepsilon, m(\widetilde{G}^\varepsilon) - m(G^\varepsilon) < \frac{\varepsilon}{3};$$

$$\exists \widetilde{G}_\varepsilon : \widetilde{G}_\varepsilon \subset \text{int } G_\varepsilon \subset G_\varepsilon, m(G_\varepsilon) - m(\widetilde{G}_\varepsilon) < \frac{\varepsilon}{3}.$$

Тогда:

$$m(\widetilde{G}^\varepsilon) - m(\widetilde{G}_\varepsilon) = m(\widetilde{G}^\varepsilon) - m(G^\varepsilon) + m(G^\varepsilon) - m(G_\varepsilon) + m(G_\varepsilon) - m(\widetilde{G}_\varepsilon) < \frac{\varepsilon}{3} + \frac{\varepsilon}{3} + \frac{\varepsilon}{3} = \varepsilon.$$

$\widetilde{G}_\varepsilon$ не содержит точки ∂X , а $\widetilde{G}^\varepsilon$ содержит их все, откуда:

$$\widetilde{G}^\varepsilon \setminus \widetilde{G}_\varepsilon - \text{клеточное множество и } \partial X \subset \widetilde{G}^\varepsilon \setminus \widetilde{G}_\varepsilon$$

$$m(\widetilde{G}^\varepsilon \setminus \widetilde{G}_\varepsilon) = m(\widetilde{G}^\varepsilon) - m(\widetilde{G}_\varepsilon) < \varepsilon \Rightarrow m(\partial X) = 0.$$

\longleftarrow :

$$X - \text{ограничено} \Rightarrow \exists Q - \text{клетка: } X \subset Q;$$

$$[m(\partial X) = 0] \stackrel{\text{def}}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists G^\varepsilon : \partial X \subset G^\varepsilon, m(G^\varepsilon) < \varepsilon]$$

$$Q \setminus G^\varepsilon - \text{клеточное множество} \Rightarrow Q \setminus G^\varepsilon = \bigcup_{j=1}^k Q_j, \quad \text{где } Q_j \text{ не содержат точек } \partial X.$$

Тогда есть два варианта:

$$[Q_j \subset X] \text{ либо } [Q_j \cap X = \emptyset]$$

$$\text{Пусть без потери общности } Q_1, Q_2, \dots, Q_l : Q_j \subset X, j = \overline{1, l};$$

$$Q_{l+1}, Q_{l+2}, \dots, Q_k : Q_j \cap X = \emptyset, j = \overline{l+1, k};$$

$$\widetilde{G}_\varepsilon = \bigcup_{j=1}^l Q_j, \quad \widetilde{G}^\varepsilon = \widetilde{G}_\varepsilon \cup G^\varepsilon = Q \setminus \left(\bigcup_{j=l+1}^k Q_j \right)$$

$$\widetilde{G}_\varepsilon \subset X \subset \widetilde{G}^\varepsilon$$

$m(G^\varepsilon) = m(\widetilde{G}^\varepsilon) - m(\widetilde{G}_\varepsilon) < \varepsilon \Rightarrow X$ измеримо по Жордану.

5.4. Примеры неизмеримых по Жордану множеств.

[1] $X = \{x \in [0, 1] : x \in \mathbb{Q}\}, X \subset \mathbb{E}^1$.
 $\partial X = [0, 1] \Rightarrow m(\partial X) = 1 \neq 0 \Rightarrow X$ неизмеримо.

[2] $Y = X \times X$, где X из [1].
 $\partial Y = [0, 1] \times [0, 1] \Rightarrow m(\partial Y) = 1 \neq 0 \Rightarrow Y$ неизмеримо.

[3] X из [1]. $X = \{a_1, a_2, \dots, a_n, \dots\}, 0 \leq a_j \leq 1$

Пусть $B = \bigcup_{j=1}^{\infty} (a_j - \frac{\varepsilon}{2^j}; a_j + \frac{\varepsilon}{2^j})$, $0 < \varepsilon < \frac{1}{2}$.

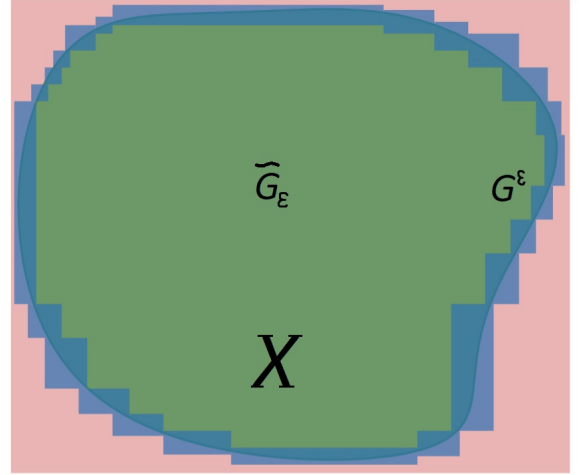
B открыто как объединение открытых множеств.

Обозначим $B_k = \bigcup_{j=1}^k (a_j - \frac{\varepsilon}{2^j}; a_j + \frac{\varepsilon}{2^j})$

$$m(B_k) \leq \sum_{j=1}^k \frac{\varepsilon}{2^{j-1}} = \varepsilon \left(\frac{1}{2} + \frac{1}{4} + \dots + \frac{1}{2^{k-1}} \right) = \varepsilon \frac{1 - \frac{1}{2^k}}{\frac{1}{2}} = 2\varepsilon \left(1 - \frac{1}{2^k} \right) < 2\varepsilon$$

Тогда $\underline{m}(B) \leq 2\varepsilon < 1$. Но $[0, 1] \subset B \Rightarrow \overline{m}(B) > 1$.

То есть $\underline{m}(B) \neq \overline{m}(B) \Rightarrow B$ неизмеримо.



5.5. Измеримость объединения, пересечения и разности измеримых множеств.

1° Если X_1 и X_2 измеримы по Жордану, то $X_1 \cup X_2$, $X_1 \cap X_2$, $X_1 \setminus X_2$ - измеримые по Жордану множества.

Доказательство:

X_1 и X_2 измеримы по Жордану $\Rightarrow X_1$ и X_2 ограничены и $m(\partial X_1) = m(\partial X_2) = 0$. Тогда и $m(\partial X_1 \cup \partial X_2) = 0$.

$$\partial(X_1 \cup X_2) \subset \partial X_1 \cup \partial X_2; \partial(X_1 \cap X_2) \subset \partial X_1 \cup \partial X_2; \partial(X_1 \setminus X_2) \subset \partial X_1 \cup \partial X_2$$

$$\downarrow$$

$$m(\partial(X_1 \cup X_2)) = m(\partial(X_1 \cap X_2)) = m(\partial(X_1 \setminus X_2)) = 0 \Rightarrow$$

$\Rightarrow X_1 \cup X_2, X_1 \cap X_2$ и $X_1 \setminus X_2$ измеримы.

5.6. Конечная аддитивность меры Жордана.

2° Пусть X_1, X_2, \dots, X_k - измеримые по Жордану множества, тогда множество $X = \bigcup_{j=1}^k X_j$ измеримо и:

$$1) m(X) \leq \sum_{j=1}^k m(X_j);$$

$$2) \text{ Если } X_j \cap X_i = \emptyset \text{ при } i \neq j, \text{ то } m(X) = \sum_{j=1}^k m(X_j).$$

Доказательство: (для $k = 2$, а дальше по индукции)

1) X_1 и X_2 измеримы по Жордану $\Rightarrow X = X_1 \cup X_2$ измеримо.

$\forall \varepsilon > 0 \exists G_1^\varepsilon, G_2^\varepsilon: X_1 \subset G_1^\varepsilon, X_2 \subset G_2^\varepsilon$ и:

$$m(X_1) > m(G_1^\varepsilon) - \frac{\varepsilon}{2}$$

$$m(X_2) > m(G_2^\varepsilon) - \frac{\varepsilon}{2}$$

Тогда $G^\varepsilon = G_1^\varepsilon \cup G_2^\varepsilon$ - клеточное множество и $X \subset G^\varepsilon$.

Получаем:

$$m(X) \leq m(G^\varepsilon) \leq m(G_1^\varepsilon) + m(G_2^\varepsilon) < m(X_1) + m(X_2) + \varepsilon.$$

В силу произвольности $\varepsilon \Rightarrow m(X) \leq m(X_1) + m(X_2)$ □*

2) $X_1 \cap X_2 = \emptyset, X = X_1 \cup X_2$

$\forall \varepsilon > 0 \exists G_\varepsilon^1, G_\varepsilon^2: G_\varepsilon^1 \subset X_1, G_\varepsilon^2 \subset X_2$ и:

$$m(G_\varepsilon^1) > m(X_1) - \frac{\varepsilon}{2}$$

$$m(G_\varepsilon^2) > m(X_2) - \frac{\varepsilon}{2}$$

$G_\varepsilon = G_\varepsilon^1 \cup G_\varepsilon^2$ и $G_\varepsilon^1 \cap G_\varepsilon^2 = \emptyset$, а также $G_\varepsilon^1 \cup G_\varepsilon^2 \subset X$.

Тогда $m(X) \geq m(G_\varepsilon) = m(G_\varepsilon^1) + m(G_\varepsilon^2) > m(X_1) + m(X_2) - \varepsilon$.

В силу произвольности $\varepsilon > 0$ получаем $m(X) \geq m(X_1) + m(X_2)$ □**

Из □* и □** $\Rightarrow m(X) = m(X_1) + m(X_2)$.

5.7. Измеримость и мера цилиндра в $(m+1)$ -мерном пространстве.

Предложение: пусть $X \subset \mathbb{E}^m, m \geq 1$, - измеримо, тогда множество $Y = X \times [a, b] \subset \mathbb{E}^{m+1}$ - измеримо. $m(Y) = m(X)(b-a)$.

Доказательство:

$$[X \text{ измеримо}] \stackrel{\text{def}}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists G_\varepsilon, G^\varepsilon : G_\varepsilon \subset X \subset G^\varepsilon, m(G^\varepsilon) - m(G_\varepsilon) < \frac{\varepsilon}{b-a}].$$

Рассмотрим клеточные множества: $\widetilde{G}_\varepsilon = G_\varepsilon \times [a, b]$ и $\widetilde{G}^\varepsilon = G^\varepsilon \times [a, b]$;

Тогда $\widetilde{G}_\varepsilon \subset Y \subset \widetilde{G}^\varepsilon$, а $m(\widetilde{G}_\varepsilon) = m(G_\varepsilon)(b-a)$ и $m(\widetilde{G}^\varepsilon) = m(G^\varepsilon)(b-a)$;

Получаем: $m(\widetilde{G}^\varepsilon) - m(\widetilde{G}_\varepsilon) = (m(G^\varepsilon) - m(G_\varepsilon))(b-a) < \frac{\varepsilon}{b-a}(b-a) = \varepsilon \Rightarrow Y$ измеримо.

6. Билет 6

6.1. Определенный интеграл Римана.

Обозначения:

$y = f(x)$ некоторая функция, $x \in [a, b]$

T – разбиение отрезка $[a, b] : T = \{a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b\}$

$\Delta x_j = x_j - x_{j-1}$, $\Delta_T = \max_{1 \leq j \leq n} \Delta x_j$ – мелкость разбиения

$\xi_j \in [x_{j-1}, x_j]$, $j = \overline{1, n}$

Определение: Число $I\{T, \xi\} = \sum_{j=1}^n f(\xi_j) \Delta x_j$ называется интегральной суммой.

Определение: Число I называется пределом интегральных сумм $I\{T, \xi\}$ при $\Delta_T \rightarrow 0$, Если $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : \forall T : \Delta_T < \delta \ \& \ \forall \{\xi\} \mapsto |I\{T, \xi\} - I| < \varepsilon$.

Определение: Функция $y = f(x)$ называется интегрируемой на $[a, b]$, если существует конечный предел I интегральных сумм $I\{T, \xi\}$ при $\Delta_T \rightarrow 0$.

Указанный предел I называется определенным интегралом функции f на $[a, b]$.

Обозначение: $I = \int_a^b f(x) dx$

Пример: $y(x) \equiv C$, $x \in [a, b]$

$$I\{T, \xi\} = C(b - a) \Rightarrow I = \int_a^b C dx = C(b - a)$$

Предложение: [Необходимое условие интегрируемости функции]:

$$[f\text{--интегрируема на } [a, b]] \Rightarrow [f\text{--ограничена на } [a, b]]$$

Доказательство: от противного:

Пусть f не является ограниченной на $[a, b]$ это означает, что $\exists k$: на $[x_{k-1}, x_k]$ функция не является ограниченной, то есть, $|f(\xi_k)| \Delta x_k$ может быть как угодно большим за счет выборки точки $\xi_k \Rightarrow I\{T, \xi\}$ неогречена и предел $I\{T, \xi\} \Delta_T \rightarrow 0$ не существует–противоречие.

Замечание: Не всякая ограниченная функция является интегрируемой на отрезке.

Пример: функция Дирихле на любом отрезке $[a, b]$ ограничена

$$y = D(x) = \begin{cases} 1, & x \in \mathbb{Q} \\ 0, & x \in \mathbb{J} \end{cases}$$

Однако:

$$\xi'_j \in \mathbb{Q}, j = \overline{1, n}$$

$$\xi''_j \in \mathbb{J}, j = \overline{1, n}$$

$$I\{T, \xi'\} = b - a \neq 0$$

$$I\{T, \xi''\} = 0, \text{ отсюда } D(x) \text{ не является интегрируемой}$$

6.2. Верхние и нижние суммы Дарбу, их свойства.

Определение: Пусть $y = f(x)$, $x \in [a, b]$, ограничена на данном отрезке; T -разбиение отрезка $[a, b]$.

$$T = \{a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b\}, \Delta x_j = x_j - x_{j-1}$$

$$m_j = \inf_{[x_{j-1}, x_j]} f(x), M_j = \sup_{[x_{j-1}, x_j]} f(x), j = \overline{1, n}, \text{ тогда:}$$

$$\underline{S}_T = \sum_{j=1}^n m_j \Delta x_j \text{—нижняя сумма Дарбу по разбиению } T$$

$$\overline{S}_T = \sum_{j=1}^n M_j \Delta x_j \text{—верхняя сумма Дарбу по разбиению } T$$

Очевидно, что при фиксированном T выполняется $\underline{S}_T \leq I\{T, \xi\} \leq \overline{S}_T$

Свойство 1: Для фиксированного T выполняется:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \xi', \xi'' : \overline{S}_T - I\{T, \xi'\} < \varepsilon, I\{T, \xi''\} - \underline{S}_T < \varepsilon$$

Доказательство: из определения $M_j = \sup_{[x_{j-1}, x_j]} f(x)$

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \xi'_j \in [x_{j-1}, x_j] : f(\xi'_j) > M_j - \frac{\varepsilon}{b-a} \Rightarrow M_j - f(\xi'_j) < \frac{\varepsilon}{b-a}$$

$$\sum_{j=1}^n (M_j - f(\xi'_j)) \Delta x_j < \sum_{j=1}^n \frac{\varepsilon}{b-a} \Delta x_j = \varepsilon \Rightarrow \sum_{j=1}^n (M_j - f(\xi'_j)) \Delta x_j =$$

$$\overline{S}_T - I\{T, \xi'\} < \varepsilon$$

Второе неравенство доказывается аналогично.

Определение: T' -измельчение разбиения T , если $T' = T \cup \{b_1 \dots b_k\}$, то есть, мы добавляем еще k точек, таким образом $\Delta_{T'} \leq \Delta_T$.

Свойство 2: При измельчении разбиения T нижние суммы Дарбу не уменьшаются, а верхние не увеличиваются.

$$T' \text{—измельчение разбиения } T, \underline{S}_T \leq \underline{S}_{T'} \leq \overline{S}_{T'} \leq \overline{S}_T$$

Доказательство: Добавим одну точку на $[x_{j-1}, x_j] : b \in (x_{j-1}, x_j), \Delta x_j = \Delta x'_j + \Delta x''_j, M'_j \leq M_j; M''_j \leq M_j$, тогда:

$$\overline{S}_T - \overline{S}_{T'} = M_j \Delta x_j - (M'_j \Delta x'_j + M''_j \Delta x''_j) = (M_j - M'_j) \Delta x'_j + (M_j - M''_j) \Delta x''_j \geq 0$$

$$\Rightarrow \overline{S}_{T'} \leq \overline{S}_T$$

Аналогично доказывается для нижних сумм.

Свойство 3: Пусть T' и T'' произвольные разбиения отрезка $[a, b]$, тогда: $\underline{S}_{T'} \leq \overline{S}_{T''}, \underline{S}_{T''} \leq \overline{S}_{T'}$

Доказательство: $T = T' \cup T''$ —измельчение разбиений T', T''

Тогда из свойства 2 следует, что $\underline{S}_{T'} \leq \underline{S}_T \leq \overline{S}_T \leq \overline{S}_{T''}$ и

$$\underline{S}_{T''} \leq \underline{S}_T \leq \overline{S}_T \leq \overline{S}_{T'}$$

Свойство 4: существуют числа $\underline{I}, \overline{I}$:

$$\underline{I} = \sup_T \underline{S}_T, \overline{I} = \inf_T \overline{S}_T \text{ такие, что для произвольных разбиений } T', T'' \text{ выполняется: } \underline{S}_{T'} \leq$$

$$\underline{I} \leq \overline{I} \leq \overline{S}_{T''}$$

\bar{I} –верхний интеграл Дарбу
 \underline{I} –нижний интеграл Дарбу.

Доказательство: следует из свойства 3 и теоремы об отделимости множеств.

Свойство 5 [Лемма Дарбу]:

$$1) [\underline{I} = \lim_{\Delta_T \rightarrow 0} \underline{S}_T] \stackrel{\text{def}}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : \forall T : \Delta_T < \delta \mapsto \underline{I} - \underline{S}_T < \varepsilon]$$

$$2) [\bar{I} = \lim_{\Delta_T \rightarrow 0} \bar{S}_T] \stackrel{\text{def}}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : \forall T : \Delta_T < \delta \mapsto \bar{S}_T - \bar{I} < \varepsilon]$$

Доказательство: 2)

$$M = \sup_{[a,b]} f(x), \quad m = \inf_{[a,b]} f(x)$$

a) $M = m$ –тривиальный случай;

b) $M > m$; $\bar{I} = \inf_T \bar{S}_T$ из определения *inf*

$$\forall \varepsilon > 0 \exists T^* : \bar{S}_{T^*} < \bar{I} + \frac{\varepsilon}{2} \Rightarrow \bar{S}_{T^*} - \bar{I} < \frac{\varepsilon}{2}$$

$$T\text{–произвольное разбиение: } \Delta_T = \max_j \Delta x_j < \frac{\varepsilon}{2(M-m)k}$$

k –количество точек разбиения T^* , лежащих на (a,b)

рассмотрим $T' = T \cup T^*$

$$0 \leq \bar{S}_T - \bar{S}_{T'} \leq (M - m)k\Delta_T < \frac{\varepsilon}{2} \text{ (оценили сверху) отсюда:}$$

$$0 \leq \bar{S}_T - \bar{S}_{T'} \leq \frac{\varepsilon}{2} \quad (1)$$

Из свойств 3 и 4: $\bar{I} \leq \bar{S}_{T'} \leq \bar{S}_{T^*}$

$$0 \leq \bar{S}_{T'} - \bar{I} \leq \bar{S}_{T^*} - \bar{I} < \frac{\varepsilon}{2} \Rightarrow$$

$$\bar{S}_{T'} - \bar{I} < \frac{\varepsilon}{2} \quad (2)$$

Складываем (1) и (2), получаем $\bar{S}_T - \bar{I} < \varepsilon$

$$\text{Итак: } \forall \varepsilon > 0 \quad \exists \delta = \delta(\varepsilon) = \frac{\varepsilon}{2(M-m)k} > 0 \quad \forall T : \Delta_T < \delta \mapsto \bar{S}_T - \bar{I} < \varepsilon$$

6.3. Критерий интегрируемости функции.

Теорема 1: Пусть функция f ограничена на $[a,b]$

$$[f \text{ интегрируема на } [a,b]] \Leftrightarrow [\forall \varepsilon > 0 \exists T : \bar{S}_T - \underline{S}_T < \varepsilon]$$

Доказательство [Необходимость]: \Rightarrow

$$[f \text{ интегрируема на } [a,b]] \stackrel{\text{def}}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : \forall T : \Delta_T < \delta \ \& \ \forall \{\xi\} \mapsto |I - I\{T, \xi\}| < \frac{\varepsilon}{4}]$$

из свойства 1: $\exists \xi', \xi''$:

$$\bar{S}_T - I\{T, \xi'\} < \frac{\varepsilon}{4}, \quad I\{T, \xi''\} - \underline{S}_T < \frac{\varepsilon}{4}, \text{ тогда}$$

$$\bar{S}_T - \underline{S}_T = |\bar{S}_T - I\{T, \xi'\} + I\{T, \xi'\} - I + I - I\{T, \xi''\} + I\{T, \xi''\} - \underline{S}_T| \leq \bar{S}_T - I\{T, \xi'\} + |I\{T, \xi'\} - I| + |I - I\{T, \xi''\}| + I\{T, \xi''\} - \underline{S}_T < 4 \cdot \frac{\varepsilon}{4} = \varepsilon \Rightarrow$$

$$\forall \varepsilon > 0 \exists T : \bar{S}_T - \underline{S}_T < \varepsilon$$

Доказательство [Достаточность]: \Leftarrow

$$\forall \varepsilon > 0 \exists T_\varepsilon^* : \bar{S}_{T_\varepsilon^*} - \underline{S}_{T_\varepsilon^*} < \varepsilon$$

Из свойства 4: существуют числа $\underline{I}, \bar{I} : \forall T \mapsto \underline{S}_T \leq \underline{I} \leq \bar{I} \leq \bar{S}_T \Rightarrow$

$0 \leq \bar{I} - \underline{I} \leq \bar{S}_{T_\varepsilon^*} - \underline{S}_{T_\varepsilon^*} < \varepsilon$ так как это выполняется для любых $\varepsilon > 0 \Rightarrow$ это возможно лишь при $\bar{I} - \underline{I} = 0, \bar{I} = \underline{I} = I$

По Лемме Дарбу:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \delta_1 = \delta_1(\varepsilon) > 0 : \forall T : \Delta_T < \delta_1 \mapsto \bar{S}_T - \bar{I} < \varepsilon$$

для этого же $\varepsilon \exists \delta_2 = \delta_2(\varepsilon) > 0 : \forall T : \Delta_T < \delta_2 \mapsto \underline{I} - \underline{S}_T < \varepsilon$
 $\delta = \min\{\delta_1, \delta_2\} \Rightarrow \forall T \Delta_T < \delta \mapsto$
 $\overline{S}_T - I < \frac{\varepsilon}{2}, I - \underline{S}_T < \frac{\varepsilon}{2}$
 $\forall T \Delta_T < \delta \ \& \ \forall \xi = \{\xi_j\} \mapsto$
 $\underline{S}_T \leq I \leq \overline{S}_T \quad (1)$
 также используем то, что $\underline{S}_T \leq I\{T, \xi\} \leq \overline{S}_T \Rightarrow$
 $-\overline{S}_T \leq -I\{T, \xi\} \leq -\underline{S}_T \quad (2)$
 Сложим (1) и (2) $\Rightarrow |I - I\{T, \xi\}| \leq \overline{S}_T - \underline{S}_T < \varepsilon$

6.4. Классы интегрируемых функций.

Теорема 2: Если $y = f(x)$ непрерывна на отрезке $[a, b]$, то f интегрируема на $[a, b]$.

Доказательство: f ограничена на $[a, b]$ по первой теореме Вейерштрасса, f равномерно непрерывна на $[a, b]$ по теореме Кантора \Rightarrow
 $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : \forall x', x'' \in [a, b] : |x' - x''| < \delta \mapsto$
 $|f(x') - f(x'')| < \frac{\varepsilon}{b-a}$
 Для этого же $\varepsilon \exists T : \Delta_T < \delta, T = \{a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b\}$
 По 2 теореме Вейерштрасса $\forall j \exists x'_j, x''_j \in [x_{j-1}, x_j] :$
 $M_j = \max_{[x_{j-1}, x_j]} f(x) = f(x'_j), m_j = \min_{[x_{j-1}, x_j]} f(x) = f(x''_j)$
 тогда из р.н. получаем, что $\forall j M_j - m_j < \frac{\varepsilon}{b-a} \Rightarrow$
 $\overline{S}_T - \underline{S}_T = \sum_{j=1}^n (M_j - m_j) \Delta x_j < \frac{\varepsilon}{b-a} \sum_{j=1}^n \Delta x_j = \frac{\varepsilon(b-a)}{b-a} = \varepsilon \Rightarrow$
 $\forall \varepsilon > 0 \exists T : \overline{S}_T - \underline{S}_T < \varepsilon.$

Теорема 3: Если функция $y = f(x)$ определена на отрезке $[a, b]$ и монотонна на отрезке, то f интегрируема на $[a, b]$.

Доказательство: для неубывающей функции: $\forall x \in [a, b] \mapsto$
 $f(a) \leq f(x) \leq f(b) \Rightarrow$ ограничена
 $\forall \varepsilon > 0 \exists T : \Delta_T < \frac{\varepsilon}{f(b)-f(a)}, T = \{a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b\}$
 $j = \overline{1, n} [x_{j-1}, x_j] \mapsto M_j = f(x_j), m_j = f(x_{j-1})$
 $\overline{S}_T - \underline{S}_T = \sum_{j=1}^n (M_j - m_j) \Delta x_j < \frac{\varepsilon}{f(b)-f(a)} (f(x_1) - f(x_0) + f(x_2) -$
 $- f(x_1) + \dots + f(x_n) - f(x_{n-1})) = \frac{\varepsilon(f(b)-f(a))}{f(b)-f(a)} = \varepsilon \Rightarrow$
 $\forall \varepsilon > 0 \exists T : \overline{S}_T - \underline{S}_T < \varepsilon$

Теорема 4: Если функция $y = f(x)$ ограничена на $[a, b]$ и $\forall \varepsilon > 0$ существует конечное число интервалов, покрывающих точки разрыва функции f , сумма длин которых не превосходит $\varepsilon \Rightarrow f$ интегрируема на $[a, b]$

Доказательство: Пусть $M = \sup_{[a, b]} f(x), m = \inf_{[a, b]} f(x)$

$\forall \varepsilon > 0 \exists X_1 = \cup_{j=1}^n \delta_j^1$ – интервал, покрывающий точки разрыва и $|\delta_j^1|$ – его длина $\Rightarrow \sum_{j=1}^n |\delta_j^1| < \frac{\varepsilon}{2(M-m)}$
 $X_2 = (a, b) \setminus \overline{X_1}$
 (a, b) – открытое, $\overline{X_1}$ – замкнутое $\Rightarrow X_2$ – открытое, то есть, мы отбросили интервалы с

точками разрыва.

$X_2 = \cup_{j=1}^k \delta_j^2$ на каждом $\delta_j^2 - f$ непрерывна $\Rightarrow f$ равномерно непрерывна на $\overline{X_2}$ (Замыкание, то есть $\overline{X_2}$ компакт – ограниченное и замкнутое)

Тогда из опр. р.н. $\exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : \forall x', x'' \in \overline{X_2} \mapsto |f(x') - f(x'')| < \frac{\varepsilon}{2(b-a)}, T = \{\delta_j^1, \delta_i^2\}_{j=1}^n, \{i=1}^k$

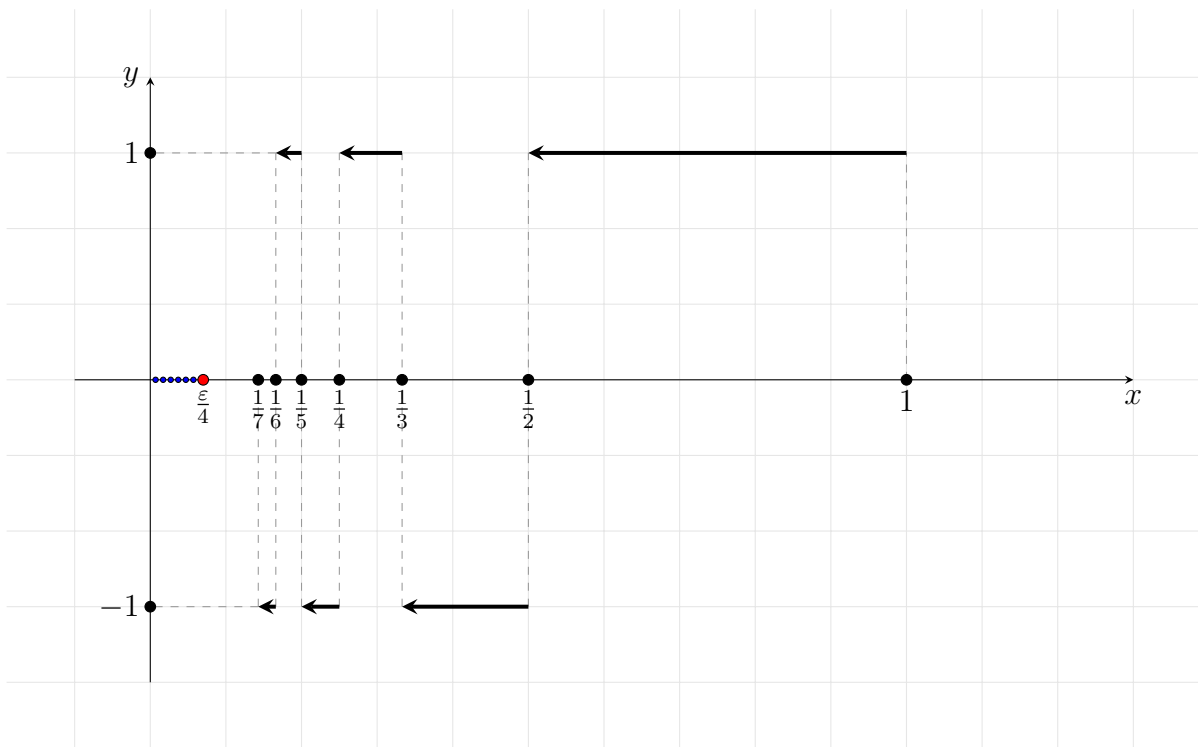
$$\overline{S}_T - \underline{S}_T = \sum_{j=1}^n (M_j - m_j) |\delta_j^1| + \sum_{i=1}^k (M_i - m_i) |\delta_i^2| \leq (M-m) \sum_{j=1}^n |\delta_j^1| + \frac{\varepsilon}{2(b-a)} \sum_{i=1}^k |\delta_i^2| < \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon(b-a)}{2(b-a)} = \varepsilon \Rightarrow \forall \varepsilon > 0 \exists T : \overline{S}_T - \underline{S}_T < \varepsilon \Rightarrow f \text{ интегрируема на } [a, b].$$

Следствие: Если функция $y = f(x)$ ограничена на $[a, b]$ и имеет на нем конечное число точек разрыва, то f интегрируема на $[a, b]$

Рассмотрим пример функции, имеющей на отрезке бесконечное число точек разрыва:

Пример:
$$f(x) = \begin{cases} 1, & x \in \left(\frac{1}{2n}, \frac{1}{2n-1}\right], n \in \mathbb{N} \\ -1, & x \in \left(\frac{1}{2n+1}, \frac{1}{2n}\right], n \in \mathbb{N} \end{cases}$$

$$x \in [0, 1]$$



Точки разрыва $\frac{1}{n}, n > 1$ на $[0, 1]$.

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \mapsto 0 < \frac{1}{n} < \frac{\varepsilon}{4}$$

Оставшиеся N точек вне данного интервала покрываем интервалами длины $\frac{\varepsilon}{4N}$, тогда сумма длин итервалов покрытия равна $\frac{\varepsilon}{4} + N \frac{\varepsilon}{4N} = \frac{\varepsilon}{2} < \varepsilon \Rightarrow$ интегрируема по теореме 4.

7. Билет 7

7.1. Некоторые свойства определенного интеграла.

Свойство 1:

$$\int_a^a f(x)dx = 0$$

Свойство 2:

$$\int_a^b f(x)dx = - \int_b^a f(x)dx$$

Свойство 3:

Если f, g интегрируемы на $[a, b]$, то $\forall \alpha, \beta \in \mathbb{R}$ функция $h = \alpha f + \beta g$ интегрируема на $[a, b]$.

Доказательство:

$$I_n\{\tau, \xi\} = \sum_{j=1}^n [\alpha f(\xi_j) + \beta g(\xi_j)] \Delta x_j = \alpha \cdot \sum_{j=1}^n f(\xi_j) \Delta x_j + \beta \cdot \sum_{j=1}^n g(\xi_j) \Delta x_j = \\ \alpha I_f\{\tau, \xi\} + \beta I_g\{\tau, \xi\}.$$

Свойство 4:

Если f и g интегрируемы на $[a, b]$, то $h = f \cdot g$ интегрируема на $[a, b]$.

Доказательство:

$\exists A > 0 \wedge \exists B > 0 : |f(x)| \leq A, |g(x)| \leq B \quad \forall x \in [a, b] \Rightarrow h$ ограничена на $[a, b]$

$$|h(x') - h(x'')| = |f(x')g(x') - f(x'')g(x'')| = |f(x')g(x') - f(x'')g(x') + \\ f(x'')g(x') - f(x'')g(x'')| \leq |g(x')| \cdot |f(x') - f(x'')| + |f(x'')| \cdot |g(x') - \\ g(x'')| \leq B|f(x') - f(x'')| + A|g(x') - g(x'')| \Rightarrow [M_j(h) - m_j(h)] \leq \\ B[M_j(f) - m_j(f)] + A[M_j(g) - m_j(g)]$$

$$f, g \text{ интегрируемы на } [a, b] \Rightarrow \forall \varepsilon > 0 \quad \exists T' : \overline{S}_{T'}(f) - \underline{S}_{T'}(f) < \frac{\varepsilon}{2B}$$

$$\exists T'' : \overline{S}_{T''}(g) - \underline{S}_{T''}(g) < \frac{\varepsilon}{2A}$$

$$T = T' \cup T''$$

$$\underline{S}_{T'}(f) \leq \underline{S}_T(f) \leq \overline{S}_T(f) \leq \overline{S}_{T'}(f) \Rightarrow \overline{S}_T(f) - \underline{S}_T(f) \leq \overline{S}_{T'}(f) - \\ \underline{S}_{T'}(f) < \frac{\varepsilon}{2B}$$

$$\underline{S}_{T''}(g) \leq \underline{S}_T(g) \leq \overline{S}_T(g) \leq \overline{S}_{T''}(g) \Rightarrow \overline{S}_T(g) - \underline{S}_T(g) \leq \overline{S}_{T''}(g) - \\ \underline{S}_{T''}(g) < \frac{\varepsilon}{2A} \Rightarrow$$

$$\overline{S}_T(h) - \underline{S}_T(h) < A \cdot \frac{\varepsilon}{2A} + B \cdot \frac{\varepsilon}{2B} = \varepsilon \Rightarrow h \text{ интегрируемая на } [a, b].$$

Свойство 5:

f интегрируема на $[a, b]$ & $[c, d] \in [a, b] \Rightarrow f$ интегрируема на $[c, d]$.

Доказательство:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists T : \overline{S_T} - \underline{S_T} < \varepsilon$$

$$T' = T \cup \{c, d\}$$

$$\overline{S_{T'}} - \underline{S_{T'}} \leq \overline{S_T} - \underline{S_T} < \varepsilon$$

$$T^* \text{ порожденное разбиением } T' \Rightarrow \overline{S_{T^*}} - \underline{S_{T^*}} \leq \overline{S_T} - \underline{S_T} < \varepsilon$$

Свойство 6:

Если f интегрируема на отрезке $[a, c]$ и $[c, b]$, то f интегрируема на $[a, b]$ и

$$\int_a^b f(x)dx = \int_a^c f(x)dx + \int_c^b f(x)dx$$

Доказательство:

Пусть $a < c < b$: $\forall \varepsilon > 0 \exists T', T''$ отрезков $[a, c]$ и $[c, b]$ $\overline{S_{T'}} - \underline{S_{T'}} < \frac{\varepsilon}{2}$, $\overline{S_{T''}} - \underline{S_{T''}} < \frac{\varepsilon}{2}$

$T = T' \cup T''$ – разбиение отрезка $[a, b]$.

$$\underline{S_{T'}} = \underline{S_T}^1 \leq \overline{S_T}^1 = \overline{S_{T'}}$$

$$\underline{S_{T''}} = \underline{S_T}^2 \leq \overline{S_T}^2 = \overline{S_{T''}}$$

$\overline{S_T} - \underline{S_T} = \overline{S_T}^1 + \overline{S_T}^2 - \underline{S_T}^1 + \underline{S_T}^2 < \varepsilon \Rightarrow f$ интегрируема на $[a, b] \Rightarrow$ интегральная сумма на $[a, b]$ есть сумма интегральных сумм на $[a, c]$ и $[c, b]$.

Пусть $c < a < b$ или $a < b < c$:

$[a, b]$ есть часть отрезка $[c, b]$ или $[a, c] \Rightarrow$ ввиду того, что интегрируемая на отрезке интегрируема на любом его участке, то f интегрируема на $[a, b]$.

Пусть $a < b < c$:

$$\int_a^b f(x)dx + \int_b^c f(x)dx = \int_a^c f(x)dx$$

$$\int_a^b f(x)dx = \int_a^c f(x)dx - \int_b^c f(x)dx \Rightarrow \int_a^b f(x)dx = \int_a^c f(x)dx + \int_c^b f(x)dx$$

Аналогично доказывается для $c < a < b$.

Свойство 7:

Пусть f ограничена на $(a, b]$, $\forall \alpha > 0 : 0 < \alpha < b - a$, f интегрируема на $[\alpha + a, b]$, тогда при любом доопределении f в точке a , получится функция, интегрируемая на $[a, b]$ и

$$\int_a^b f(x)dx = \lim_{\alpha \rightarrow 0} \int_{a+\alpha}^b f(x)dx.$$

Доказательство:

$$\exists A > 0 : \forall x \in (a, b] \mapsto |f(x)| \leq A, f(a) = B$$

$$M = \max\{A, |B|\} \Rightarrow \forall x \in [a, b], |f(x)| \leq M$$

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \alpha = \alpha(\varepsilon) : 2M\alpha < \varepsilon/2$$

Для $[a + \alpha, b]$ найдется такое $\exists T : \overline{S_T} - \underline{S_T} < \varepsilon/2$

$$\exists T' = T \cup \{a\}, \overline{S_{T'}} - \underline{S_{T'}} = \overline{S_T} - \underline{S_T} - (M_0 - m_0)\alpha < \varepsilon/2 + 2M\alpha < \varepsilon/2 + \varepsilon/2 = \varepsilon$$

7.2. Оценки определенного интеграла.

Оценка 1:

f интегрируема на $[a, b]$ & $f(x) \geq 0 \forall x \in [a, b] \Rightarrow \int_a^b f(x)dx \geq 0$.

Доказательство:

$f(x) \geq 0 \forall x \in [a, b] \Rightarrow \forall T$ & $\forall \{\xi\} \mapsto I\{T, \xi\} \geq 0, I$ — предел интегральных сумм.

Теперь надо доказать, что при $\Delta_T \rightarrow 0 \mapsto I \geq 0$

От противного:

$I < 0 \Rightarrow \varepsilon = \frac{|I|}{2} \exists \delta(\varepsilon) > 0 : \forall T, \Delta_T < \delta \mapsto |I\{T, \xi\} - I| < \frac{|I|}{2} \Rightarrow I - \frac{|I|}{2} < I\{T, \xi\} < I + \frac{|I|}{2} < 0 \Rightarrow I\{T, \xi\} < 0$ — противоречие.

Оценка 2:

f непрерывна на $[a, b]$ & $f(x) \geq 0 \forall x \in [a, b]$ & $f \not\equiv 0 \Rightarrow \int_a^b f(x)dx \geq j > 0$.

Доказательство:

$\exists x_0 \in (a, b) : f(x_0) = 2\alpha > 0 \Rightarrow$ [по теореме о сохранении знака непрерывной функции]
 $\Rightarrow \exists [c, d] \subset [a, b], x \in [c, d] : f(x) \geq \alpha > 0$ на $[c, d] \Rightarrow f(x) - \alpha \geq 0$ на $[c, d]$ ^{св-во 5 и оц-ка 1}
 $\int_c^d (f(x) - \alpha)dx \geq 0 \Rightarrow \int_c^d f(x)dx \geq \int_c^d \alpha dx = \alpha(d - c) = j > 0$

$$\int_c^d f(x)dx \geq j > 0 \Rightarrow \int_a^c f(x)dx + \int_c^d f(x)dx + \int_d^b f(x)dx \geq 0 + j + 0 > 0$$

Оценка 3:

f, g интегрируемы на $[a, b]$ & $\forall x \in [a, b] \mapsto f(x) \geq g(x) \Rightarrow \int_a^b f(x)dx \geq \int_a^b g(x)dx$.

Доказательство:

$$f(x) - g(x) \geq 0 \forall x \in [a, b] \xRightarrow{\text{оц-ка 1}} \int_a^b [f(x) - g(x)]dx \geq 0 \xRightarrow{\text{св-во 2}} \int_a^b f(x)dx - \int_a^b g(x)dx \geq 0$$

Оценка 4: Если $y = f(x)$ интегрируема на $[a, b]$, то $y = |f(x)|$ интегрируема на $[a, b]$ и

$$\left| \int_a^b f(x)dx \right| \leq \int_a^b |f(x)|dx$$

Доказательство:

Пусть $|f|$ — интегрируема.

$$T = \{a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b\}$$

$$M_j = \sup_{[x_{j-1}, x_j]} f(x), m_j = \inf_{[x_{j-1}, x_j]} f(x)$$

$$\overline{M}_j = \sup_{[x_{j-1}, x_j]} |f(x)|, \overline{m}_j = \inf_{[x_{j-1}, x_j]} |f(x)|$$

$$\overline{M}_j - \overline{m}_j \leq M_j - m_j \quad (*)$$

1) $M_j > 0, m_j > 0 \Rightarrow$ очевидное равенство в $(*)$

2) $M_j < 0, m_j < 0 \Rightarrow$ очевидное равенство в $(*)$

3) $M_j > 0, m_j < 0 \Rightarrow \overline{M}_j - \overline{m}_j < M_j - m_j$

Из $(*)$ следует:

$$\overline{S}_T(|f|) - \underline{S}_T(|f|) \leq \overline{S}_T(f) - \underline{S}_T(f) < \varepsilon$$

$$\forall \varepsilon > 0 \exists T : \overline{S}_T(|f|) - \underline{S}_T(|f|) < \varepsilon \Rightarrow$$

$$\Rightarrow |f| \text{ интегрируема и } -|f(x)| \leq f(x) \leq |f(x)|$$

Вспомним, что если $y = f(x)$ и $y = g(x)$ интегрируемы на $[a, b]$ и $f(x) \geq g(x) \forall x \in [a, b]$,
то $\int_a^b f(x) dx \geq \int_a^b g(x) dx$, тогда

$$\begin{aligned} - \int_a^b |f(x)| dx &\leq \int_a^b f(x) dx \leq \int_a^b |f(x)| dx \Rightarrow \\ &\Rightarrow \left| \int_a^b f(x) dx \right| \leq \int_a^b |f(x)| dx \end{aligned}$$

Замечание: $|f|$ – интегрируема $\nRightarrow f$ – интегрируема.

Пример:

$$y = \tilde{D}(x) = \begin{cases} 1, & x \in \mathbb{Q}; \\ -1, & x \in \mathbb{I}; \end{cases}$$

Оценка 5:

Пусть $y = f(x)$, $y = g(x)$ интегрируемы на $[a, b]$ и $g(x) \geq 0 \forall x \in [a, b]$.

Если $M = \sup_{[a, b]} f(x)$, $m = \inf_{[a, b]} f(x)$, то

$$m \int_a^b g(x) dx \leq \int_a^b f(x) \cdot g(x) dx \leq M \int_a^b g(x) dx$$

Доказательство:

$$m \leq f(x) \leq M \quad \forall x \in [a, b] \quad g(x) \geq 0 \Rightarrow m \cdot g(x) \leq f(x) \cdot g(x) \leq M \cdot g(x)$$

\Rightarrow исходное условие доказано исходя из оценки 3 и свойства 3.

Предложение [Формула среднего значения]:

Пусть f интегрируема на $[a, b]$, $M = \sup_{[a, b]} f(x)$, $m = \inf_{[a, b]} f(x)$. Тогда $\exists \mu : m \leq \mu \leq M$

такое, что

$$\int_a^b f(x)dx = \mu(b-a)$$

Доказательство:

Из оценки интегрирования неравенств (результата предыдущего пункта) при $g \equiv 1 \Rightarrow$

$$m(b-a) \leq \int_a^b f(x)dx \leq M(b-a) \Rightarrow \mu = \frac{\int_a^b f(x)dx}{b-a}.$$

Теорема [Интегральная теорема о среднем]:

Пусть f и g интегрируемы на $[a, b]$. $M = \sup_{[a,b]} f(x)$, $m = \inf_{[a,b]} f(x)$ и $g(x) \geq 0 \forall x \in [a, b]$

(либо $g(x) \leq 0$). Тогда $\exists \mu : m \leq \mu \leq M$ такая, что

$$\int_a^b f(x) \cdot g(x)dx = \mu \int_a^b g(x)dx$$

В частности, если f непрерывна на $[a, b]$, то $\exists \xi \in [a, b] :$

$$\int_a^b f(x) \cdot g(x)dx = f(\xi) \cdot \int_a^b g(x)dx$$

Доказательство:

$$1. \ 1) \int_a^b g(x)dx = 0$$

\Rightarrow оценка интегрирования неравенства $\Rightarrow \int_a^b f(x)g(x) = 0$ и μ — любое число

$$2. \ 2) \int_a^b g(x)dx > 0$$

\Rightarrow Оценка интегрирования неравенства

$$m \leq \frac{\int_a^b f(x)dx}{\int_a^b g(x)dx} \leq M \text{ и } \mu = \frac{\int_a^b f(x)dx}{\int_a^b g(x)dx}$$

Если f непрерывна на $[a, b] \Rightarrow \exists \xi : \mu = f(\xi)$

Предложение:

Пусть f интегрируема на $[a, b]$, $m = \inf_{[a,b]} f$, $M = \sup_{[a,b]} f \Rightarrow \exists \mu : m \leq \mu \leq M : \int_a^b f(x)g(x)dx =$

$\mu \int_a^b g(x)dx$, если f непрерывна на $[a, b]$, то $\exists \xi \in [a, b] : \int_a^b f(x)g(x)dx = f(\xi) \int_a^b g(x)dx$ [$g \equiv 1$].

7.3. Интегралы с переменным верхним пределом. Вычисление определенных интегралов.

Определение:

Пусть $y = f(x)$ интегрируема на $[a, b] \Rightarrow \forall x \in [a, b]$ существует

$$\int_a^x f(t)dt = F(x)$$

Этот интеграл называется интегралом с переменным верхним пределом.

Теорема:

Любая непрерывная на $[a, b]$ функция $y = f(x)$ имеет на этом отрезке первообразную. Одной из первообразных является функция

$$F(x) = \int_a^x f(t)dt, x \in [a, b]$$

Доказательство:

$\forall x \in [a, b], x + \Delta x \in [a, b]$. Докажем, что

$$\lim_{\Delta x \rightarrow 0} \frac{F(x + \Delta x) - F(x)}{\Delta x} = f(x)$$

$$F(x + \Delta x) - F(x) = \int_x^{x+\Delta x} f(t)dt$$

По теореме о среднем $\exists \xi$, лежащая между x и $x + \Delta x$: $F(x + \Delta x) - F(x) = f(\xi)\Delta x \Rightarrow \frac{F(x + \Delta x) - F(x)}{\Delta x} = f(\xi)$

Так как f непрерывна на $[a, b]$, то при $\Delta x \rightarrow 0 \Rightarrow f(\xi) \xrightarrow{\Delta x \rightarrow 0} f(x)$ и

$$\lim_{\Delta x \rightarrow 0} \frac{F(x + \Delta x) - F(x)}{\Delta x} = F'(x)$$

Замечание:

Из доказательства теоремы следует, что

$$\frac{d}{dx} \int_a^x f(t)dt = f(x)$$

Предложение: Если f интегрируема на $[a, b]$, то F непрерывна на $[a, b]$.

Доказательство:

$\forall \epsilon \in [a, b], x + \Delta x \in [a, b], F(x + \Delta x) - F(x) = \Delta F(x, \Delta x)$.

$\Delta F(x, \Delta x) = \int_x^{x+\Delta x} f(t)dt = \mu \Delta x : m \leq \mu \leq M$ (Формула среднего значения)

$\Delta x \rightarrow 0 \Rightarrow \Delta F(x, \Delta x) \rightarrow 0 \Rightarrow F$ непрерывна в X .

Замечание:

Если f непрерывна на $[a, b] \Rightarrow \forall \Phi(x) = \int_a^x f(t)dt + C$.

$$\Phi(a) = C, \Phi(b) = \int_a^b f(x)dx + C \Rightarrow \int_a^b f(x)dx = \Phi(b) - \Phi(a).$$

Теорема [Формула Ньютона-Лейбница]:

Если f непрерывна на $[a, b]$, то $\int_a^b f(x)dx = \Phi(b) - \Phi(a)$, где Φ — любая первообразная функции f .

Доказательство:

См. предыдущее замечание..

Теорема 7:

Если f :

- 1) интегрируема на $[a, b]$;
- 2) обладает на $[a, b]$ первообразной Φ ;

то справедлива формула $\int_a^b f(x)dx = \Phi(b) - \Phi(a)$.

Замечание:

- 1) $y = \operatorname{sgn} x, x \in [-1, 1]$ интегрируема на $[-1, 1]$, но не обладает первообразной.

$$2) F(x) = \begin{cases} 2x \sin \frac{1}{x^2}, & |x| \leq 1, x \neq 0 \\ 0, & x = 0 \end{cases} \quad \text{является первообразной для}$$

$$f(x) = \begin{cases} 2x \sin \frac{1}{x^2} - \frac{2}{x} \cos \frac{1}{x^2}, & |x| \leq 1, x \neq 0 \\ 0, & x = 0 \end{cases}$$

$$F'(0) = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{x^2 \sin \frac{1}{x^2}}{x} = 0 \quad f \text{ не является интегрируемой на } [-1, 1] \text{ (не ограничена).}$$

Теорема [Замена переменных в определенном интегрировании]:

Пусть выполнены следующие условия:

- 1) $y = f(x)$ непрерывна на $[a, b]$
- 2) $x = g(t)$ непрерывно дифференцируема на $[a, b]$
- 3) $g(\alpha) = a, g(\beta) = b$ и $\forall t \in [\alpha, \beta] \mapsto a \leq g(t) \leq b$

тогда справедлива формула $\int_a^b f(x)dx = \int_{\alpha}^{\beta} f(g(t))g'(t)dt$.

Доказательство:

Φ — первообразная функции $f \Rightarrow \int_a^b f(x)dx = \Phi(b) - \Phi(a)$.

Т.к. Φ и g дифференцируемы на $[a, b]$ и $[\alpha, \beta]$ соответственно, то

$$\frac{d}{dt} [\Phi(g(t))] = \Phi'(g(t)) \cdot g'(t), \text{ но } \Phi'(x) = f(x) \rightarrow \Phi'(g(t)) = f(g(t)) \Rightarrow$$

$$\frac{d}{dt} [\Phi(g(t))] = f(g(t)) \cdot g'(t)$$

По условию $f(g(t)) \cdot g'(t)$ непрерывна на $[\alpha, \beta]$ и $\Phi(g(t))$ — её первообразная.

$$\int_{\alpha}^{\beta} f(g(t))g'(t)dt = \Phi(g(\beta)) - \Phi(g(\alpha)) = \Phi(b) - \Phi(a) = \int_a^b f(x)dx$$

Теорема [Формула интегрирования по частям]:

Пусть $u = u(x), v = v(x)$ непрерывно дифференцируемые на $[a, b]$. Тогда

$$\int_a^b u dv = [uv]_a^b - \int_a^b v du$$

Доказательство:

Функция $u \cdot v$ является первообразной функции $uv' + u'v$. Каждая из этих функций непрерывная \Rightarrow

$$\int_a^b [uv' + u'v] dx = [uv]_a^b$$

8. Билет 8

8.1. Геометрические приложения определенного интеграла.

Площадь криволинейной трапеции.

Определение:

Пусть на $[a, b]$ задана функция $f: \forall x \in [a, b] \rightarrow f(x) \geq 0$

Множество $G = \{(x, y) : a \leq x \leq b, 0 \leq y \leq f(x)\}$ называется криволинейной трапецией

Интегрируемость криволинейной трапеции по Жордану была доказана ранее.

Предложение:

Площадь $m(X)$ криволинейной трапеции X определяется формулой $m(X) = \int_a^b f(x) dx$.

Доказательство:

f интегр. на $[a, b] \Rightarrow \forall \varepsilon > 0 \exists T : \overline{S_T} - \underline{S_T} < \varepsilon$

НО $m(G_\varepsilon) = \underline{S_T} \leq I \leq \overline{S_T} = m(G^\varepsilon)$

$m(G_\varepsilon) \leq m(x) \leq m(G^\varepsilon)$

$m(x) = I = \int_a^b f(x) dx$.

Площадь криволинейного сектора.

Определение:

$r = r(\varphi)$ непр. на $[\alpha, \beta]$. Криволинейный сектор измерим по Жордану.

Приложение:

Площадь $m(X)$ криволинейного сектора вычисляется по формуле $m(X) = \frac{1}{2} \int_\alpha^\beta r^2(\varphi) d\varphi$.

Доказательство:

$T = \{\alpha = \varphi_0 < \varphi_1 < \dots < \varphi_n = \beta\}$

$\Delta\varphi_i = \varphi_i - \varphi_{i-1}, i = \overline{1, n}$

$R_i = \max r(\varphi) [\varphi_i, \varphi_{i-1}] \quad r_i = \min r(\varphi) [\varphi_i, \varphi_{i-1}]$

$\overline{S_T} = \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n R_i^2 \Delta\varphi_i, \quad \underline{S_T} = \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n r_i^2 \Delta\varphi_i$.

Это верхняя и нижняя сумма Дарбу функции $\frac{1}{2} r^2(\varphi)$.

Это функция интегр. на $[a, b]$.

$\underline{S_T} \leq I \leq \overline{S_T}$ и $I = m(X) = \frac{1}{2} \int_\alpha^\beta r^2(\varphi) d\varphi$.

Объем тела вращения:

Определение:

Тело, полученное путем вращения криволинейной трапеции вокруг оси x назовём телом вращения.

Предложение:

Объем $m(X)$ тела вращения X криволинейной трапеции вокруг x вычисляется по формуле $m(X) = \pi \int_a^b [f(x)]^2 dx$.

Доказательство: $T = a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b$

$$M_i = \max(f(x_{i-1}), f(x_i)), \quad m_i = \min(f(x_{i-1}), f(x_i))$$

$$\overline{S}_T = \pi \sum_{i=1}^n M_i^2 \Delta x_i, \quad \underline{S}_T = \pi \sum_{i=1}^n m_i^2 \Delta x_i$$

Это суммы Дарбу функции $y = \pi f^2(x)$, которая интегрируема на $[\varepsilon_i, b]$

$$\underline{S}_T \leq m(X) = I \leq \overline{S}_T \Rightarrow m(X) = I = \pi \int_a^b f^2(x) dx.$$

Длина дуги кривой.

$\Gamma = \{\vec{r} = \vec{r}(t)S, \quad \alpha \leq t \leq \beta\}$ непрерывно дифференцируема \Rightarrow спрямляемая кривая.

Предложение:

Если кривая Γ непрерывно дифференцируема, то ее длина L вычисляется по формуле

$$L = \int_a^b |\vec{r}'(t)| dt.$$

Доказательство: $S'(t) = |\vec{r}'(t)|$

$$L = S(\beta) - S(\alpha) = \int_{\alpha}^{\beta} S'(t) dt = \int_{\alpha}^{\beta} |\vec{r}'(t)| dt.$$

$$1. \quad \vec{r} = \vec{r}(t) = \{x(t), y(t), z(t)\}, t \in [\alpha, \beta] \quad L = \int_{\alpha}^{\beta} \sqrt{[x'(t)]^2 + [y'(t)]^2 + [z'(t)]^2} dt$$

$$2. \quad y = f(x), \alpha \leq x \leq \beta \quad L = \int_{\alpha}^{\beta} \sqrt{1 + [f'(x)]^2} dx$$

$$3. \quad r = r(\varphi), \varphi_1 \leq \varphi \leq \varphi_2$$

$$\begin{cases} x = r \cos(\varphi) \\ y = r \sin(\varphi) \end{cases}$$

$$\begin{cases} x' = r' \cos(\varphi) - r \sin(\varphi) \\ y' = r' \sin(\varphi) + r \cos(\varphi) \end{cases}$$

$$(x')^2 + (y')^2 = (r')^2 + (r)^2 \quad (1)$$

$$L = \int_{\alpha}^{\beta} \sqrt{(r')^2 + (r)^2} d\varphi \quad (2)$$

8.2. Вычисление площади поверхности вращения.

Пусть $y = f(x)$, $x \in [a, b]$ и $f(x)$ непрерывна на $[a, b]$.

Рассмотрим поверхность Π вращения графика функции f вокруг Ox . $T = \{a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b\}$.

$$A_0(x_0, f(x_0)), A_1(x_1, f(x_1)) \dots A_n(x_n, f(x_n)) .$$

Строим ломанную $A_0, A_1 \dots A_n$. При вращении ломанной вокруг оси x , получаем поверхность Π_T , составляющую одну из боковых поверхностей усеченных конусов, обозначим эту площадь за P_T .

$$P_T = 2\pi \sum_{i=1}^n \frac{f(x_{i-1}) + f(x_i)}{2} l_i = \pi \sum_{i=1}^n [f(x_{i-1}) + f(x_i)] l_i, \text{ где } l_i - \text{длина звена } A_{i-1}A_i.$$

Определение: Число P называется пределом площади P_T при мелкости разбиения, стремящимся к нулю, если $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon) > 0 : \forall T : \Delta_T < \delta \rightarrow |P_T - P| < \varepsilon$.

Определение: Поверхность Π называется квадратируемой, если существует предел площадей P_T при мелкости разбиения, стремящейся к 0. При этом P называется площадью поверхности Π .

Предложение: Если $y = f(x)$ непрерывно дифференцируема на $[a, b]$, $f(x) \geq 0 \forall x \in [a, b]$, то поверхность вращения Π графика $y = f(x)$ вокруг x , квадратируема и ее площадь вычисляется по формуле $P = 2\pi \int_a^b f(x) \sqrt{1 + [f'(x)]^2} dx$.

Без доказательства.

8.3. Криволинейные интегралы первого рода.

Определение: Если существует предел I интегральной суммы σ_T при $\Delta S_T \rightarrow 0$, то этот предел называют *криволинейным интегралом первого рода* функции f по кривой Γ .

Обозначение: $I = \int_{\Gamma} f(x, y) dS$

Определение: Если существует предел I интегральной суммы $\sigma_T^x [\sigma_T^y]$ при $\Delta S_T \rightarrow 0$, то этот предел называют *криволинейным интегралом второго рода* функции $P(Q)$ по кривой Γ .

Обозначение: $I = \int_{\Gamma} P(x, y) dx, \int_{\Gamma} Q(x, y) dy$.

Сумму $\int_{\Gamma} P(x, y) dx + Q(x, y) dy$ называют *криволинейный интеграл второго рода*.

Физический смысл крив. инт. 1-го рода - это масса кривой Γ , плотность которой задана функцией $\rho = f(x, y)$.

Физический смысл крив. инт. 2-го рода - это это работа по перемещению материальной точки вдоль кривой Γ под действием силы, имеющей компоненты $u = P(x, y), v = Q(x, y)$.

Замечание: Значение криволинейного интеграла 1-го рода не зависит от направления обхода кривой Γ .

Для криволинейного интеграла 2-го рода изменение направления обхода меняет знак.

8.4. Несобственный интеграл.

Определение:

Пусть $y = f(x)$ интегр на $[a, \xi] \forall \xi : \xi > a$. Символ $\int_a^\infty f(x)dx$ наз. несобств. интегралом функции $y = f(x)$ по промежутку $[a; +\infty]$.

Если существует и конечен предел $\lim_{\xi \rightarrow \infty} I(\xi) = A, A \in R$, то несобственный интеграл $I = \int_a^\infty f(x)dx$ называется сходящимся и равен числу A .

Обозначение: $\int_a^\infty f(x)dx < 0 \equiv$ интеграл сходится.

Соглашение: несобственный интеграл будет записываться как $\int_a^b f(x)dx$, где $b = \infty$ или b - вертикальная асимптота $f(x)$.

Свойства несобственных интегралов и их вычисление:

1. $\int_a^b f(x)dx = \int_a^c f(x)dx + \int_c^b f(x)dx$
 $\forall c : a < c < b :$

$$\left[\int_a^b f(x)dx < \infty \right] \Leftrightarrow \int_c^b f(x)dx < \infty$$

2. $\left[\left[\int_a^b f(x)dx < \infty \right] \ \& \ \left[\int_a^b g(x)dx < \infty \right] \right] \Rightarrow \int_a^b [\alpha f(x) + \beta g(x)]dx = \alpha \int_a^b f(x)dx + \beta \int_a^b g(x)dx$

3. Пусть $y = f(x)$ непрерывна на $[a, b)$ и $F'(x) = f(x) \forall x \in [a, b)$ и $\lim_{x \rightarrow b-0} F(x) = F(b-0) \in R$.

Тогда:

$$\int_a^b f(x)dx = F(b-0) - F(a) \quad \text{Формула Ньютона-Лейбница}$$

4. Интегрирование по частям работает так же как и неопределенных интегралах.

5. Пусть $y = f(x)$ непр. на $[a, b)$, $x = \varphi(t)$ непр. дифф. и возр на $[\alpha, \beta)$, $\varphi(\alpha) = a$, $\lim_{t \rightarrow \beta-0} \varphi(t) = b$. Тогда:

$$\int_a^b f(x)dx = \int_\alpha^\beta f(\varphi(t))\varphi'(t)dt$$

при условии сходимости хотя бы одного интегралов равенства

6.

$$\left[\left[\int_a^b f(x)dx < \infty \right] \ \& \ \left[\int_a^b g(x)dx < \infty \right] \ \& \ [f(x) < g(x)] \right] \Rightarrow \int_a^b f(x)dx < \int_a^b g(x)dx$$

8.5. Несобственные интегралы от неотрицательных функций:

Теорема 1: $\left[\int_a^b f(x)dx < \infty \right] \Leftrightarrow \left[I(\xi) = \int_a^\xi f(x)dx \text{ огр. на } [a, b] \right]$.

Доказательство:

Необходимость: $\int_a^b f(x)dx \Rightarrow I(\xi)$ ограничена на $[a, b]$.

$\int_a^b f(x)dx \stackrel{\text{def}}{=} \exists \lim_{\xi \rightarrow b-0} I(\xi) = A \in R \Rightarrow A = \sup_{\xi \in [a, b]} I(\xi)$ (A – это точная верхняя грань)
 $\Rightarrow 0 \leq I(\xi) \leq A \Rightarrow$ функция ограничена.

Достаточность: $I(\xi)$ огр. на $[a, b] \Rightarrow \int_a^b f(x)dx < \infty$

$I(\xi)$ огр. на $[a, b] \stackrel{\text{def}}{=} \exists C > 0 : \forall \xi \in [a, b] \mapsto 0 \leq I(\xi) \leq C \Rightarrow \exists A = \sup_{\xi \in [a, b]} I(\xi)$

Из $A = \sup_{\xi \in [a, b]} I(\xi)$ следует:

1. $\forall \xi \in [a, b] \mapsto I(\xi) \leq A$
2. $\forall \varepsilon > 0 \exists \xi_\varepsilon \in (a, B) : I(\xi_\varepsilon) > A - \varepsilon$
 $\xi_\varepsilon = \delta \Rightarrow \forall \xi \in (\delta, b) \mapsto I(\xi) \geq I(\xi_\varepsilon) > A - \varepsilon$

Тогда $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta \in (a, b) : \forall \xi \in (\delta, b) \mapsto 0 \leq A - I(\xi) < \varepsilon \stackrel{\text{def}}{=} \lim_{\xi \rightarrow b-0} I(\xi) = A \in R \stackrel{\text{def}}{=} \int_a^b f(x)dx < \infty$.

Теорема 2 [Признак сравнения]: Пусть $\forall x \in [a, b] \mapsto 0 \leq f(x) \leq g(x)$. Тогда:

1. $\int_a^b g(x)dx < \infty \Rightarrow \int_a^b f(x)dx < \infty$
2. $\int_a^b f(x)dx = \infty \Rightarrow \int_a^b g(x)dx = \infty$

Доказательство:

1. $\int_a^b g(x)dx < \infty \iff (\text{Из } T_1) G(\xi) = \int_a^\xi g(x)dx \text{ ограничена на полуинтервале } \stackrel{\text{def}}{=} \exists C \geq 0 : \forall \xi \in [a, b] \mapsto G(\xi) \leq C.$

$$I(\xi) = \int_a^\xi f(x)dx \leq \int_a^\xi g(x)dx \leq C \Rightarrow (\text{из } T_1) \int_a^b f(x)dx < \infty.$$

2. $\int_a^b f(x)dx = \infty \Rightarrow \int_a^b g(x)dx = \infty.$

В противном случае: $\int_a^b g(x)dx < \infty \Rightarrow (\text{из } \Pi_1) \int_a^b f(x)dx < \infty.$

Следствие (Признак сравнения в предельной форме)

Если $f(x) > 0$, $g(x) > 0$, $\forall x \in [a, b)$, $f(x) \sim g(x)$ $x \rightarrow b - 0$, $\int_a^b f(x)dx$ и $\int_a^b g(x)dx$ ведут себя одинаково.

Доказательство:

$$\left[\lim_{x \rightarrow b-0} \frac{f(x)}{g(x)} = 1 \right] \Rightarrow [\varepsilon = 1/2. \exists \delta \in (a, b) : \forall x \in (\delta, b) \mapsto \left| \frac{f(x)}{g(x)} - 1 \right| < \frac{1}{2}]$$

$\frac{1}{2}g(x) < f(x) < \frac{3}{2}g(x)$ Далее просто применяем T_2 и Π_2 .

8.6. Критерий Коши сходимости несобственных интегралов.

Пусть функция интегрируема в собст. смысле на промежутке из $[a, b)$. Тогда:

$$\left[\int_a^b f(x)dx < \infty \right] \stackrel{\text{def}}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists \delta \in (a, b) : \forall \xi', \xi'' \in (\delta, b) \mapsto \left| \int_{\xi'}^{\xi''} f(x)dx \right| < \varepsilon]$$

Доказательство:

$$\begin{aligned} \left[\int_a^b f(x)dx < \infty \right] &\iff [\exists \lim_{\xi \rightarrow b-0} \int_a^{\xi} f(x)dx = \lim_{\xi \rightarrow b-0} I(\xi) = A \in R] \iff \\ &\iff [\forall \varepsilon > 0 \exists \delta \in (a, b) : \forall \xi', \xi'' \in (\delta, b) \mapsto |I(\xi') - I(\xi'')| < \varepsilon] \end{aligned}$$

$$\left| \int_{\xi'}^{\xi''} f(x)dx \right| < \varepsilon \iff \left| \int_{\xi'}^{\xi''} f(x)dx \right| < \varepsilon$$

8.7. Абсолютная и условная сходимость несобственных интегралов.

Определение 1 Интеграл $\int_a^b f(x)dx$ наз. абсолютно сход., если $\int_a^b |f(x)|dx < \infty$.

Предложение: Если интеграл сходится абсолютно, он сходится условно.

Доказательство

$\forall \xi', \xi'' \in (a, b)$

$\left| \int_{\xi'}^{\xi''} f(x)dx \right| \leq \int_{\xi'}^{\xi''} |f(x)|dx$. Тогда по критерию Коши $\left| \int_{\xi'}^{\xi''} f(x)dx \right|$ сходится и из 2 сходится

и $\int_{\xi'}^{\xi''} |f(x)|dx$.

Определение 2 Если $\int_a^b |f(x)|dx = \infty$, а $\int_a^b f(x)dx < \infty$, $\int_a^b f(x)dx$ наз. условно сходящимся.

Предложение: Если $\int_a^b g(x)dx$ сходится абсолютно, то $\int_a^b f(x)dx$ и $\int_a^b f(x) + g(x)dx$ ведут себя одинаково.

Доказательство: Абсолютная сходимость:

$$\int_a^b |f(x)|dx < \infty \Rightarrow |f(x) + g(x)| \leq |f(x)| + |g(x)| \Rightarrow \int_a^b |f(x) + g(x)|dx < \infty$$

В другую сторону: $\int_a^b |f(x) + g(x)|dx < \infty \Rightarrow f(x) = [f(x) + g(x)] - g(x) \Rightarrow |f(x)| \leq |f(x) + g(x)| \Rightarrow$ по 2 $\int_a^b |f(x)|dx < \infty$.

8.8. Признаки Дирихле и Абеля сходимости интегралов.

Теорема [Признак Дирихле]: Если выполнены условия:

1. $f(x)$ непр, $g(x)$ непр. дифф. на $[a, b]$
2. $F(x) = \int_a^b f(t)dt$ ограничена на $[a, b]$
3. $g(x)$ монотонна на $[a, b]$ и $\lim_{x \rightarrow b-0} g(x) = 0$

Тогда $\int_a^b f(x) \cdot g(x)dx < \infty$.

Доказательство:

$$\forall \xi', \xi'' \in [a, b]$$

Сделаем замену для интегрирования по частям:

$$u = g(x), du = g'(x)dx, dv = f(x)dx, v = F(x).$$

$$\int_{\xi'}^{\xi''} g(x)dx = g(x) \cdot F(x) \Big|_{\xi'}^{\xi''} - \int_{\xi'}^{\xi''} g'(x)F(x)dx$$

$$\left| \int_{\xi'}^{\xi''} f(x)g(x)dx \right| \leq M(|g(\xi')| + |g(\xi'')|) \pm M \int_{\xi'}^{\xi''} g'(x) \leq 2M(|g(\xi')| + |g(\xi'')|)$$

$$\left[\lim_{x \rightarrow b-0} g(x) = 0 \right] \stackrel{\text{def}}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists \delta(\varepsilon) \in (a, b) \forall x \in (\delta, b) \mapsto |g(x)| \leq \frac{\varepsilon}{4M} \Rightarrow$$

$$\Rightarrow \forall \xi', \xi'' \in (\delta, b) \mapsto \left| \int_{\xi'}^{\xi''} f(x)g(x)dx \right| < 2M\left(\frac{\varepsilon}{4M} + \frac{\varepsilon}{4M}\right) = \varepsilon \Rightarrow$$

$$\text{по критерию Коши } \int_a^b f(x)g(x) < \infty$$

Следствие (Признак Абеля): Если выполняются условия:

1. $f(x)$ непр, $g(x)$ непр. дифф. на $[a, b)$
2. $\int_a^b f(x) < \infty$
3. $g(x)$ монотонна и ограничена на $[a, b)$

Тогда $\int_a^b f(x) \cdot g(x) dx < \infty$.

Доказательство:

Из условия 3 следует, что $\exists \lim_{x \rightarrow b-0} g(x) = g(b-0) \in R$

$$g_1(x) = g(x) - g(b-0) \xrightarrow{x \rightarrow b-0} 0 \Rightarrow \left(\int_a^b f(x) g_1(x) dx < \infty \right)$$

$$\int_a^b f(x) g_1(x) dx = \int_a^b f(x) g(x) dx + g(b-0) \int_a^b f(x) dx$$

$$\int_a^b f(x) g_1(x) dx \text{ и } \int_a^b f(x) dx \text{ сходятся, значит сходится и } \int_a^b f(x) g(x) dx$$

9. Билет 9

9.1. Числовые ряды.

Определение: Пусть задана числовая последовательность $\{u_k\}_{k=1}^{\infty}$. Выражение $u_1 + u_2 + \dots + u_k + \dots$ будем называть *числовым рядом*.

Обозначение: $\sum_{k=1}^{\infty} u_k$
 u_k — член ряда.

$S_n = \sum_{k=1}^n u_k$ — n -ая частичная сумма ряда.

Определение: Ряд $\sum_{k=1}^{\infty} u_k$ *сходится*, если последовательность $\{S_n\}_{n=1}^{\infty}$ сходится и $S = \lim_{n \rightarrow \infty} S_n$ — *сумма ряда*. Если $\{S_n\}_{n=1}^{\infty}$ расходится, то и ряд $\sum_{k=1}^{\infty} u_k$ *расходится*.

Обозначения:

$\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty$ — ряд сходится

$\sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty$ — ряд расходится

Примеры:

1. $\sum_{k=1}^{\infty} (-1)^{k-1} = 1 - 1 + 1 - 1 + \dots + 1 - 1 + \dots$

$$S_1 = 1, S_2 = 0, S_3 = 1, S_4 = 0, \dots$$

$$S_{2k-1} = 1, S_{2k} = 0 \Rightarrow \{S_n\}_{n=1}^{\infty} \text{ расходящаяся} \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty$$

2. $\sum_{k=1}^{\infty} q^{k-1} = 1 + q + \dots + q^{n-1} + \dots$

$$S_n = 1 + q + \dots + q^{n-1} = \frac{1 - q^n}{1 - q} = \frac{1}{1 - q} - \frac{q^n}{1 - q}$$

а) $|q| < 1 \Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} q^n = 0 \Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} S_n = \frac{1}{1 - q} = S$

б) $|q| > 1 \Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} |q|^n = \infty \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} q^{k-1} = \infty$

в) $q = 1 \Rightarrow S_n = n \xrightarrow{n \rightarrow \infty} +\infty \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} q^{k-1} = \infty$

г) $q = -1 \Rightarrow$ пример 1) $\Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} q^{k-1} = \infty$

3. $\sum_{k=1}^{\infty} \frac{x^{k-1}}{(k-1)!} = 1 + \frac{x}{1!} + \frac{x^2}{2!} + \dots + \frac{x^k}{k!} + \dots$

$$e^x = 1 + \frac{x}{1!} + \frac{x^2}{2!} + \dots + \frac{x^{n-1}}{(n-1)!} + e^{\xi x} \cdot \frac{x^n}{n!}, \quad 0 < \xi < 1$$

$$|e^x - S_n| \leq e^x \cdot \frac{x^n}{n!} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$$

9.2. Критерий Коши сходимости ряда.

Теорема:

$$\left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty \right] \Leftrightarrow \left[\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \ \& \ \forall p \in \mathbb{N} \mapsto \left| \sum_{k=n+1}^{n+p} u_k \right| < \varepsilon \right]$$

Доказательство:

$$|S_{n+p} - S_n| = \left| \sum_{k=n+1}^{n+p} u_k \right|$$

Условие теоремы означает, что $\{S_n\}$ – фундаментальна $\Leftrightarrow \{S_n\}$ сходится

Обозначение: $r_n = \sum_{k=n+1}^{\infty} u_k$ – n -й остаток числового ряда

Следствие:

$$\left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty \right] \Leftrightarrow [\{r_n\}_{n=1}^{\infty} \text{ сходится}]$$

Доказательство:

$$[\{r_n\}_{n=1}^{\infty} \text{ сходится}] \Leftrightarrow [\{r_n\}_{n=1}^{\infty} \text{ фундаментальна}] \Leftrightarrow [\text{условие критерия Коши}]$$

Следствие [Необходимое условие сходимости числового ряда]:

$$\left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty \right] \Rightarrow \left[\lim_{k \rightarrow \infty} u_k = 0 \right]$$

Доказательство:

Следует из условия критерия Коши при $p = 1$.

$$[\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \mapsto |u_{n+1}| < \varepsilon] \stackrel{\text{def}}{=} \left[\lim_{k \rightarrow \infty} u_k = 0 \right]$$

Отрицание условия Коши:

$$\left[\exists \varepsilon_0 > 0 : \forall n \exists n_0 \geq n \ \& \ \exists p_0 \in \mathbb{N} : \left| \sum_{k=n_0+1}^{n_0+p_0} u_k \right| \geq \varepsilon_0 \right]$$

Пример:

$\sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k}$ – гармонический ряд

$\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{1}{k} = 0$, но

$$\begin{aligned} \exists \varepsilon_0 = \frac{1}{4} : \forall n \exists n_0 = n \ \& \ \exists p_0 = n : \sum_{k=n+1}^{2n} \frac{1}{k} = \\ = \frac{1}{n+1} + \frac{1}{n+2} + \dots + \frac{1}{2n} \geq \frac{1}{2n} \cdot n = \frac{1}{2} > \frac{1}{4} = \varepsilon_0 \end{aligned}$$

Предложение 1: Добавление (отбрасывание) конечного числа членов ряда не влияет на его поведение.

Доказательство:

$$\sum_{k=1}^{\infty} u_k \pm \sum_{k=1}^{k_0} \alpha_k = \sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k$$

$$\forall n > n_0 \mapsto \tilde{S}_n = S_n + A, \quad A = \sum_{k=1}^{k_0} \alpha_k$$

Если $\{S_n\}$ сходится [расходится], то $\{\tilde{S}_n\}$ сходится [расходится].

Предложение 2:

$\tilde{u}_k = cu_k, c \in \mathbb{R}, c \neq 0 \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} u_k$ и $\sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k$ ведут себя одинаково.

9.3. Знакопостоянные ряды: признак сравнения сходимости, признаки Даламбера и Коши, интегральный признак.

$$\sum_{k=1}^{\infty} u_k, u_k \geq 0 \quad \forall k, \quad \{S_n\}_{n=1}^{\infty} - \text{неубывающая.}$$

Теорема 2 [Критерий сходимости числового ряда с неотр. членами]:

$$\left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty \right] \Leftrightarrow [\{S_n\}_{n=1}^{\infty} \text{ ограничена}]$$

Доказательство:

$$[\{S_n\}_{n=1}^{\infty} \text{ сходится}] \Leftrightarrow [\{S_n\}_{n=1}^{\infty} \text{ ограничена}] \quad (\text{т.к. монотонная})$$

Теорема 3 [Признак сравнения]:

$$\forall k \mapsto 0 \leq u_k \leq \tilde{u}_k$$

$$1. \sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k < \infty \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty$$

$$2. \sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k = \infty$$

Доказательство:

$$1. \sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k < \infty, \text{ т.е. } \exists \lim_{n \rightarrow \infty} \tilde{S}_n = \tilde{S} \in \mathbb{R}$$

$$\forall n \mapsto S_n \leq \tilde{S}_n \leq \tilde{S} \Rightarrow \{S_n\} \text{ ограничена} \xrightarrow{2} \sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty$$

$$2. \sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty \xrightarrow{1)} \sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k = \infty$$

Замечание:

1. В **Теореме 3** $\boxed{\forall k}$ можно заменить на $\boxed{\forall k \geq k_0, k_0 \in \mathbb{N}}$, т.к. отбрасывание конечного числа членов ряда не влияет на его поведение.
2. Неравенство $0 \leq u_k \leq \tilde{u}_k$ можно заменить $0 \leq u_k \leq c\tilde{u}_k, c > 0$, т.к. умножение на действительное число c не влияет на поведение числового ряда.

Следствие:

$$[\forall k [\forall k \geq k_0] \mapsto u_k > 0, \tilde{u}_k > 0 \text{ и } u_k \sim \tilde{u}_k] \Rightarrow$$

$$\Rightarrow \left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k, \sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k \text{ ведут себя одинаково} \right]$$

Доказательство:

$$\left[\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{u_k}{\tilde{u}_k} = 1 \right] \stackrel{\text{def}}{=} \left[\forall \varepsilon > 0 \exists K = K(\varepsilon) : \forall k \geq K \mapsto \left| \frac{u_k}{\tilde{u}_k} - 1 \right| < \varepsilon \right] \Rightarrow$$

$$\Rightarrow \forall k \geq K \mapsto (1 - \varepsilon)\tilde{u}_k < u_k < (1 + \varepsilon)\tilde{u}_k$$

$$0 < \varepsilon < \frac{1}{2}$$

Утверждение следует из **Теоремы 3** и **Замечания 2**.

Примеры:

$$1. \sum_{k=1}^{\infty} u_k, u_k = \frac{1}{3 + b^k}$$

$$\text{а) } b \leq 1 \Rightarrow \lim_{k \rightarrow \infty} u_k \neq 0 \Rightarrow \text{не выполнено НУС} \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty$$

$$\text{б) } b > 1$$

$$u_k = \frac{1}{3 + b^k} \leq \left(\frac{1}{b} \right)^k = q^k, \quad 0 < q < 1$$

$$\sum_{k=1}^{\infty} q^k < \infty \stackrel{.3}{\Rightarrow} \sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty$$

$$2. \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^\alpha}, \quad 0 < \alpha \leq 1$$

$$\frac{1}{k^\alpha} \geq \frac{1}{k}, \quad \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k} = \infty \stackrel{.3}{\Rightarrow} \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^\alpha} = \infty$$

$$3. \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^2} = \sum_{k=1}^{\infty} u_k \quad k > 1 \Rightarrow \frac{1}{k^2} \leq \frac{1}{k(k-1)} = \tilde{u}_k$$

$$\frac{1}{k(k-1)} = \frac{1}{k-1} - \frac{1}{k} \Rightarrow \tilde{S}_n = 1 - \frac{1}{2} + \frac{1}{2} - \frac{1}{3} + \dots + \frac{1}{n-1} - \frac{1}{n} = 1 - \frac{1}{n} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 1$$

$$\sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k < \infty \stackrel{.3}{\Rightarrow} \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^2} < \infty$$

$$\forall \alpha \geq 2 \mapsto \frac{1}{k^\alpha} \leq \frac{1}{k^2} \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^\alpha} < \infty \text{ при } \alpha \geq 2$$

Теорема 4 [Признак сравнения]:

$$\left[\forall k \mapsto u_k > 0, \tilde{u}_k > 0 \text{ и } \frac{u_{k+1}}{u_k} \leq \frac{\tilde{u}_{k+1}}{\tilde{u}_k} \right] \Rightarrow$$

$$1. \sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k < \infty \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty$$

$$2. \sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k = \infty$$

Доказательство:

$$\times \begin{cases} \frac{u_2}{u_1} \leq \frac{\tilde{u}_2}{\tilde{u}_1} \\ \frac{u_3}{u_2} \leq \frac{\tilde{u}_3}{\tilde{u}_2} \\ \dots \\ \frac{u_k}{u_{k-1}} \leq \frac{\tilde{u}_k}{\tilde{u}_{k-1}} \end{cases} \Rightarrow \frac{u_k}{u_1} \leq \frac{\tilde{u}_k}{\tilde{u}_1} \Rightarrow u_k \leq c \tilde{u}_k, c = \frac{u_1}{\tilde{u}_1} > 0$$

Утверждение **Теоремы 4** следует из **Теоремы 3** и **Замечания 2**.

Теорема 5 [Признак Даламбера]:

$$\forall k [\forall k \geq k_0] \mapsto u_k > 0$$

$$1. \left[\frac{u_{k+1}}{u_k} \leq q < 1 \right] \Rightarrow \left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty \right]$$

$$2. \left[\frac{u_{k+1}}{u_k} \geq 1 \right] \Rightarrow \left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty \right]$$

Доказательство:

$$1. \tilde{u}_k = q^k$$

$$\frac{\tilde{u}_{k+1}}{\tilde{u}_k} = q \Rightarrow \frac{u_{k+1}}{u_k} \leq \frac{\tilde{u}_{k+1}}{\tilde{u}_k} = q < 1$$

$$\sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k = \sum_{k=1}^{\infty} q^k \xRightarrow{.4} \sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty$$

$$2. \tilde{u}_k = 1$$

$$\frac{u_{k+1}}{u_k} \geq \frac{\tilde{u}_{k+1}}{\tilde{u}_k} = 1, \quad \sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k = \infty \xRightarrow{.4} \sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty$$

Теорема 6 [Признак Даламбера в предельной форме]:

$$[\forall k [\forall k \geq k_0] \mapsto u_k > 0] \& \left[\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{u_{k+1}}{u_k} = L \in \mathbb{R} \right] \Rightarrow$$

$$1. [L < 1] \Rightarrow \left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty \right]$$

$$2. [L > 1] \Rightarrow \left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty \right]$$

Доказательство:

$$1. L < 1 \Rightarrow \exists \alpha > 0 : L = 1 - 2\alpha \Rightarrow L + \alpha = 1 - \alpha = q < 1$$

$$\varepsilon = \alpha \exists K = K(\varepsilon) : \forall k \geq K \mapsto 0 < \frac{u_{k+1}}{u_k} < L + \alpha = 1 - \alpha = q < 1 \xRightarrow{.5} \sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty$$

$$2. L > 1 \Rightarrow \exists \alpha > 0 : L = 1 + \alpha \Rightarrow L - \alpha = 1$$

$$\varepsilon = \alpha \exists K = K(\varepsilon) : \forall k \geq K \mapsto \frac{u_{k+1}}{u_k} > L - \alpha = 1 \xrightarrow{.5} \sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty$$

Замечание:

1. В **Теореме 5** неравенство $\frac{u_{k+1}}{u_k} \leq q < 1$ **нельзя** заменить неравенством $\frac{u_{k+1}}{u_k} < 1$.

$$\sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k} \mapsto \frac{k}{k+1} < 1 \forall k, \text{ но } \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k} = \infty$$

2. Для $L = 1$ (в **Теореме 6**) признак Даламбера в предельной форме «не работает».

$$\sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k} = \infty, \quad \lim_{k \rightarrow \infty} \frac{k}{k+1} = 1$$

$$\sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^2} < \infty, \quad \lim_{k \rightarrow \infty} \frac{k^2}{(k+1)^2} = 1$$

Теорема 7 [Признак Коши]:

$$\forall k [\forall k \geq k_0] \mapsto u_k > 0$$

$$1. [\sqrt[k]{u_k} \leq q < 1] \Rightarrow \left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty \right]$$

$$2. [\sqrt[k]{u_k} \geq 1] \Rightarrow \left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty \right]$$

Доказательство:

$$1. \tilde{u}_k = q^k \Rightarrow \sqrt[k]{u_k} \leq \sqrt[k]{\tilde{u}_k} = q < 1 \Rightarrow u_k \leq \tilde{u}_k$$

$$\sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k < \infty \xrightarrow{.3} \sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty$$

$$2. \tilde{u}_k = 1 \Rightarrow \sqrt[k]{u_k} \geq \sqrt[k]{\tilde{u}_k} = 1 \Rightarrow u_k \geq \tilde{u}_k$$

$$\sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k = \infty \xrightarrow{.3} \sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty$$

Теорема 8 [Признак Коши в предельной форме]:

$$[\forall k [\forall k \geq k_0] \mapsto u_k > 0] \& \left[\lim_{k \rightarrow \infty} \sqrt[k]{u_k} = L \in \mathbb{R} \right] \Rightarrow$$

$$1. [L < 1] \Rightarrow \left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty \right]$$

$$2. [L > 1] \Rightarrow \left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty \right]$$

Доказательство:

$$1. L < 1 \Rightarrow \exists \alpha > 0 : L = 1 - 2\alpha \Rightarrow L + \alpha = 1 - \alpha = q < 1$$

$$\varepsilon = \alpha \exists K = K(\varepsilon) : \forall k \geq K \mapsto 0 < \sqrt[k]{u_k} < L + \alpha = 1 - \alpha = q < 1 \xrightarrow{.7} \sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty$$

$$2. L > 1 \Rightarrow \exists \alpha > 0 : L = 1 + \alpha \Rightarrow L - \alpha = 1$$

$$\varepsilon = \alpha \exists K = K(\varepsilon) : \forall k \geq K \mapsto \sqrt[k]{u_k} > L - \alpha = 1 \stackrel{.7}{\Rightarrow} \sum_{k=1}^{\infty} u_k = \infty$$

Замечание:

1. В **Теореме 7** неравенство $\sqrt[k]{u_k} \leq q < 1$ **нельзя** заменить неравенством $\sqrt[k]{u_k} < 1$.
2. Для $L = 1$ (в **Теореме 8**) признак Коши в предельной форме «не работает».
3. Предельный признак Коши более сильный, чем предельный признак Даламбера.

$$\sum_{k=1}^{\infty} u_k, \quad u_k = \frac{3 + (-1)^k}{2^{k+1}}, \quad \frac{u_{k+1}}{u_k} = \frac{1}{2} \cdot \frac{3 + (-1)^{k+1}}{3 + (-1)^k}$$

$$\begin{cases} k=1 : \frac{u_2}{u_1} = \frac{1}{2} \cdot 2 = 1 \\ k=2 : \frac{u_3}{u_2} = \frac{1}{2} \cdot \frac{1}{2} = \frac{1}{4} \end{cases} \Rightarrow \lim_{k \rightarrow \infty} \frac{u_{k+1}}{u_k} \text{ не существует}$$

Теорема 9 [Признак Коши—Маклорена][интегральный признак]:

Пусть f — неотрицательная и невозрастающая на $[m; +\infty)$, $m \in \mathbb{N}$. Тогда

$$\left[\sum_{k=m}^{\infty} f(k) < \infty \right] \Leftrightarrow \left[\exists \lim_{n \rightarrow \infty} \alpha_n = \alpha \in \mathbb{R}, \quad \alpha_n = \int_m^n f(x) dx \right], \quad n \geq m+1$$

$$\left(\lim_{n \rightarrow \infty} \alpha_n = \int_m^{+\infty} f(x) dx \right)$$

Доказательство:

$$\forall k \geq m+1 \mapsto k-1 \leq x \leq k \Rightarrow f(k) \leq f(x) \leq f(k-1)$$

$[k-1; k]$: f — монотонная и ограниченная $\Rightarrow f$ интегрируема

$$f(k) \leq \int_{k-1}^k f(x) dx \leq f(k-1), \quad k \geq m+1$$

$$+ \begin{cases} f(m+1) \leq \int_m^{m+1} f(x) dx \leq f(m) \\ f(m+2) \leq \int_{m+1}^{m+2} f(x) dx \leq f(m+1) \\ \dots \\ f(n) \leq \int_{n-1}^n f(x) dx \leq f(n-1) \end{cases}$$

$$S_n = \sum_{k=m}^n f(k)$$

$$S_n - f(m) \leq \int_m^n f(x) dx \leq S_{n-1} \Rightarrow \{\alpha_n\} \text{ сходится} \Leftrightarrow \{S_n\} \text{ ограничена}$$

Примеры:

$$1. \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^{\alpha}}, \alpha > 1$$

$$\int_1^{+\infty} \frac{1}{x^{\alpha}} dx < \infty, \text{ если } \alpha > 1 \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^{\alpha}} < \infty \text{ при } \alpha > 1.$$

$$2. \sum_{k=2}^{\infty} \frac{1}{k \ln^{\beta} k}$$

$$\int_2^{+\infty} \frac{dx}{x \ln^{\beta} x} < \infty \text{ при } \beta > 1 \Rightarrow \sum_{k=2}^{\infty} \frac{1}{k \ln^{\beta} k} < \infty \text{ при } \beta > 1.$$

9.4. Знакопеременные ряды, абсолютная и условная сходимость, признаки Лейбница, Дирихле и Абеля.

$$\sum_{k=1}^{\infty} u_k$$

Определение: Если $\sum_{k=1}^{\infty} |u_k| < \infty \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} u_k$ — абсолютно сходящийся ряд.

Предложение:

$$\left[\sum_{k=1}^{\infty} |u_k| < \infty \right] \Rightarrow \left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty \right]$$

Доказательство:

По Критерию Коши сходимости числового ряда:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \ \& \ \forall p \in \mathbb{N} \mapsto \sum_{k=n+1}^{n+p} |u_k| < \varepsilon$$

$$\left| \sum_{k=n+1}^{n+p} u_k \right| \leq \sum_{k=n+1}^{n+p} |u_k| < \varepsilon$$

Определение: Если $\sum_{k=1}^{\infty} |u_k| = \infty$ и $\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty$, то $\sum_{k=1}^{\infty} u_k$ — условно сходящийся ряд.

Примеры:

$$1. \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k-1}}{k^{\alpha}}, \alpha > 1$$

$$\left| \frac{(-1)^{k-1}}{k^{\alpha}} \right| = \frac{1}{k^{\alpha}}, \quad \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^{\alpha}} < \infty \text{ при } \alpha > 1 \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k-1}}{k^{\alpha}} \text{ сходится абсолютно.}$$

$$2. \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k-1}}{k} = \sum_{k=1}^{\infty} u_k$$

$$|u_k| = \frac{1}{k}, \quad \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k} = \infty$$

$$\sum_{k=1}^{\infty} u_k = 1 - \frac{1}{2} + \frac{1}{3} - \frac{1}{4} + \dots + \frac{1}{2n-1} - \frac{1}{2n} + \dots$$

$$\ln(1+x) = x - \frac{x}{2} + \frac{x}{3} - \dots + \frac{(-1)^n x^n}{n} + R_{n+1}(x)$$

$$R_{n+1}(x) = [\ln(1+x)]^{(n+1)}(\theta x) \cdot \frac{x^{n+1}}{(n+1)!}, \quad 0 < \theta < 1$$

$$[\ln(1+x)]^{(n+1)}(\theta x) = \frac{(-1)^n n!}{(1+\theta x)^{n+1}}$$

$$\ln 2 = 1 - \frac{1}{2} + \frac{1}{3} - \frac{1}{4} + \dots + \frac{(-1)^n}{n} + R_{n+1}(1)$$

$$|R_{n+1}(x)| \leq \frac{|x|^{n+1}}{n+1}$$

$$|S_n - \ln 2| = |R_{n+1}(x)| \leq \frac{1}{n+1} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$$

$$\sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k-1}}{k} = \ln 2 \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k-1}}{k} \text{ сходитсЯ условно}$$

Тождество Абеля:

$$\{u_k\}_{k=1}^{\infty}, \{v_k\}_{k=1}^{\infty}, \quad S_n = u_1 + \dots + u_n, \quad u_k = S_k - S_{k-1}, \quad k = 2, 3, \dots$$

$$\begin{aligned} \sum_{k=n}^{n+p} u_k v_k &= \sum_{k=n}^{n+p} S_k v_k - \sum_{k=n}^{n+p} S_{k-1} v_k = \sum_{k=n}^{n+p} S_k v_k - \sum_{k=n-1}^{n+p-1} S_k v_{k+1} = \\ &= \sum_{k=n}^{n+p-1} S_k (v_k - v_{k+1}) + S_{n+p} v_{n+p} - S_{n-1} v_n \end{aligned}$$

$$\sum_{k=n}^{n+p} (S_k - S_{k-1}) v_k = S_{n+p} v_{n+p} - S_{n-1} v_n - \sum_{k=n}^{n+p-1} S_k (v_{k+1} - v_k)$$

Теорема [Признак Лейбница]:

$$\left[\sum_{k=1}^{\infty} (-1)^{k-1} v_k, \quad 0 \leq v_{k+1} \leq v_k, \quad v_k \xrightarrow{k \rightarrow \infty} 0 \right] \Rightarrow \left[\sum_{k=1}^{\infty} (-1)^{k-1} v_k < \infty \right]$$

Доказательство:

$$S_{2n} = v_1 - v_2 + v_3 - v_4 + \dots + v_{2n-1} - v_{2n} \geq 0$$

$$\{S_{2n}\} - \text{неубывающая и ограниченная} \Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} S_{2n} = S \in \mathbb{R}$$

$$S_{2n} = v_1 - \underbrace{(v_2 - v_3)}_{\geq 0} - \underbrace{(v_4 - v_5)}_{\geq 0} - \dots - \underbrace{(v_{2n-2} - v_{2n-1})}_{\geq 0} - v_{2n} \Rightarrow S_{2n} \leq v_1 \quad \forall n$$

$$S_{2n-1} = S_{2n} + v_{2n} \Rightarrow S_{2n-1} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} S$$

Теорема [Признак Дирихле]: Пусть

1. $\{\mathcal{U}_n\}$ – послед. частичных сумм $\sum_{k=1}^{\infty} u_k$ ограничена, $U_n = \sum_{k=1}^n u_k$
2. $\{v_k\}$ – монотонна и $v_k \xrightarrow{k \rightarrow \infty} 0$

$$\text{Тогда } \sum_{k=1}^{\infty} u_k v_k < \infty$$

Доказательство:

$$\exists C > 0 : \forall n \in \mathbb{N} \mapsto |\mathcal{U}_n| \leq C$$

$$\{v_k\} - \text{невозрастающая и } v_k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} 0 \Rightarrow \forall \varepsilon > 0 \exists K = K(\varepsilon) : \forall k \geq K \mapsto 0 \leq v_k \leq \frac{\varepsilon}{2C}$$

$$\forall p \in \mathbb{N} \mapsto \left| \sum_{k=n}^{n+p} u_k v_k \right| \leq C v_{n+p} + C v_n + C \sum_{k=n}^{n+p-1} (v_k - v_{k+1}) \leq 2C v_n < \varepsilon$$

Следствие [Признак Абеля]: Пусть

1. $\sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty$
2. $\{v_k\}$ – монотонна и ограничена

Тогда $\sum_{k=1}^{\infty} u_k v_k < \infty$

Доказательство:

$$\{v_k\} \text{ монотонна и ограничена } \Rightarrow \{v_k\} \text{ сходится } \Rightarrow \lim_{k \rightarrow \infty} v_k = v \in \mathbb{R}$$

$$\tilde{v}_k = v_k - v \text{ монотонна и } \tilde{v}_k \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} 0$$

$$\{\mathcal{U}_n\} \text{ сходится } \Rightarrow \{\mathcal{U}_n\} \text{ ограничена}$$

$$\underbrace{\sum_{k=1}^{\infty} u_k \tilde{v}_k}_{< \infty \text{ по пр. Дирихле}} = \sum_{k=1}^{\infty} u_k v_k - v \underbrace{\sum_{k=1}^{\infty} u_k}_{< \infty \text{ по усл.}} \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} u_k v_k < \infty$$

Примеры:

1. $\sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^k}{\sqrt{k}}$, $\frac{1}{\sqrt{k}}$ убывает и $\frac{1}{\sqrt{k}} \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} 0 \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^k}{\sqrt{k}} < \infty$ (по признаку Лейбница)
2. $\sum_{k=1}^{\infty} \frac{\cos kx}{k}$, x – фиксированное число, $x \neq 2\pi m$, т.к. получится гармонический ряд
 $v_k = \frac{1}{k}$, $u_k = \cos kx$, $S_n = \sum_{k=1}^n \cos kx$

$$\begin{aligned} \sin \frac{x}{2} \cdot S_n &= \sum_{k=1}^n \sin \frac{x}{2} \cdot \cos kx = \frac{1}{2} \sum_{k=1}^n \left[\sin \left(\frac{2k+1}{2} \right) x - \sin \left(\frac{2k-1}{2} \right) x \right] = \\ &= \frac{1}{2} \left[\sin \frac{3x}{2} - \sin \frac{x}{2} + \dots + \sin \left(\frac{2n+1}{2} \right) x - \sin \left(\frac{2n-1}{2} \right) x \right] \end{aligned}$$

$$|S_n| = \left| \frac{\sin \left(\frac{2n+1}{2} \right) x - \sin \frac{x}{2}}{2 \sin \frac{x}{2}} \right| \leq \frac{1}{|\sin \frac{x}{2}|} \quad \forall n, \quad x \neq 2\pi m \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \frac{\cos kx}{k} < \infty \text{ (по признаку Дирихле)}$$

$$3. 1 + \frac{1}{2} - \frac{2}{3} + \frac{1}{4} + \frac{1}{5} - \frac{2}{6} + \frac{1}{7} + \frac{1}{8} - \frac{2}{9} + \dots = \sum_{k=1}^{\infty} \left(\frac{1}{3k-2} + \frac{1}{3k-1} - \frac{2}{3k} \right)$$

$$v_k = \frac{1}{k}$$

$$u_1 = 1, u_2 = 1, u_3 = -2, u_4 = 1, u_5 = 1, u_6 = -2, \dots$$

$$S_1 = 1, S_2 = 2, S_3 = 0, S_4 = 1, S_5 = 2, S_6 = 0, \dots$$

$$S_n \leq 2 \quad \forall n \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} u_k < \infty \text{ (по признаку Дирихле)}$$

9.5. Независимость суммы абсолютно сходящегося ряда от порядка слагаемых.

Теорема [Коши]:

Если $\sum_{k=1}^{\infty} u_k$ сходится абсолютно и $\sum_{k=1}^{\infty} u_k = S$, то любой $\sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k$, полученный из исходного перестановкой членов, является абсолютно сходящимся и $\sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k = S$.

Доказательство:

$$\circledast \quad S_n = \sum_{k=1}^n u_k, \quad \tilde{S}_n = \sum_{k=1}^n \tilde{u}_k$$

$$\left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k \text{ сх. абс.} \right] \Leftrightarrow \left[\forall \varepsilon > 0 \exists N_1 = N_1(\varepsilon) : \forall n \geq N_1 \ \& \ \forall p \in \mathbb{N} \mapsto \sum_{k=n+1}^{n+p} |u_k| < \frac{\varepsilon}{2} \right]$$

$$\left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k = S \right] \stackrel{\text{def}}{=} \left[\forall \varepsilon > 0 \exists N_2 = N_2(\varepsilon) : \forall n \geq N_2 \mapsto |S_n - S| < \frac{\varepsilon}{2} \right]$$

$$N_0 = \max\{N_1; N_2\}$$

$$\forall p \in \mathbb{N} \mapsto \sum_{k=N_0+1}^{N_0+p} |u_k| < \frac{\varepsilon}{2}, \quad |S_{N_0} - S| < \frac{\varepsilon}{2}$$

$\tilde{S}_n : \forall n \geq N : S_n$ содержит все N_0 первых членов исходного ряда

$$|\tilde{S}_n - S| = |(\tilde{S}_n - S_{N_0}) + (S_{N_0} - S)| \leq \underbrace{|\tilde{S}_n - S_{N_0}|}_{n-N_0 \text{ членов}} + \frac{\varepsilon}{2}$$

Число $p \in \mathbb{N}$ выбираем таким образом, чтобы $N_0 + p$ был больше номеров членов ряда, содержащихся в $\tilde{S}_n - S_{N_0} \Rightarrow |\tilde{S}_n - S_{N_0}| \leq \sum_{k=N_0+1}^{N_0+p} |u_k| < \frac{\varepsilon}{2}$, тогда

$$|\tilde{S}_n - S| < \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon}{2} = \varepsilon$$

Для доказательства абсолютной сходимости повторяем \circledast для рядов $\sum_{k=1}^{\infty} |u_k|$ и $\sum_{k=1}^{\infty} |\tilde{u}_k|$.

9.6. Теорема Римана о перестановках членов условно сходящегося ряда.

$$\sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k-1}}{k} = 1 - \frac{1}{2} + \frac{1}{3} - \frac{1}{4} + \frac{1}{5} - \frac{1}{6} + \dots = \ln 2 = \sum_{k=1}^{\infty} u_k$$

$$1 - \frac{1}{2} - \frac{1}{4} + \frac{1}{3} - \frac{1}{6} - \frac{1}{8} + \dots + \frac{1}{2n-1} - \frac{1}{4n-2} - \frac{1}{4n} + \dots = \sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k$$

$$\begin{cases} \tilde{S}_{3m} = \frac{1}{2} \sum_{k=1}^{3m} \left(\frac{1}{2k-1} - \frac{1}{2k} \right) = \frac{1}{2} S_n, \quad n = 3m \xrightarrow{m \rightarrow \infty} \frac{1}{2} \ln 2 \\ \tilde{S}_{3m-1} = \frac{1}{2} S_n + \frac{1}{4n} \xrightarrow{m \rightarrow \infty} \frac{1}{2} \ln 2 \\ \tilde{S}_{3m-2} = \frac{1}{2} S_n + \frac{1}{4n} + \frac{1}{4n-2} \xrightarrow{m \rightarrow \infty} \frac{1}{2} \ln 2 \end{cases} \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \tilde{u}_k = \frac{1}{2} \ln 2$$

Теорема [Риман]:

Если числовой ряд сходится условно, то каково бы ни было число S , члены ряда можно переставить так, что полученный ряд сходится к S .

9.7. Произведение абсолютно сходящихся рядов.

Теорема [О сумме абсолютно сходящихся рядов]: Если

$$\sum_{k=1}^{\infty} u_k = \mathcal{U} \in \mathbb{R}, \quad \sum_{k=1}^{\infty} v_k = \mathcal{V} \in \mathbb{R}, \text{ то}$$

$$\sum_{k=1}^{\infty} (u_k \pm v_k) = \mathcal{U} \pm \mathcal{V}$$

Доказательство:

$$\mathcal{U}_n = \sum_{k=1}^n u_k, \quad \mathcal{V}_n = \sum_{k=1}^n v_k$$

$$S_n = \sum_{k=1}^n (u_k \pm v_k) = \mathcal{U}_n \pm \mathcal{V}_n \xrightarrow{n \rightarrow \infty} \mathcal{U} \pm \mathcal{V}$$

Теорема [О произведении абсолютно сходящихся рядов]:

$$\left[\sum_{k=1}^{\infty} u_k = \mathcal{U} - \text{абс. сход.}, \sum_{k=1}^{\infty} v_k = \mathcal{V} - \text{абс. сход.} \right] \Rightarrow$$

$$\Rightarrow \left[\sum_{k,l=1}^{\infty} u_k v_l = \sum_{j=1}^{\infty} w_j \text{ сход. абс. и } \sum_{j=1}^{\infty} w_j = \mathcal{U} \cdot \mathcal{V} \right]$$

Доказательство:

$$\bar{S}_n = \sum_{j=1}^{\infty} w_j$$

Пусть m – наибольший индекс из индексов k и l , входящих в $\bar{S}_n \Rightarrow \bar{S}_n \leq (|u_1| + |u_2| + \dots + |u_m|)(|v_1| + |v_2| + \dots + |v_m|)$

$\sum_{k=1}^{\infty} u_k$ и $\sum_{k=1}^{\infty} v_k$ сход. абс. $\Rightarrow \{\bar{\mathcal{U}}_m\}, \{\bar{\mathcal{V}}_m\}$ ограничены $\Rightarrow \{\bar{S}_n\}$ ограничена $\Rightarrow \sum_{j=1}^{\infty} |w_j| < \infty$
 $\Rightarrow \sum_{j=1}^{\infty} w_j$ сход. абс.

$$\mathcal{W}_n = (u_1 + \dots + u_n)(v_1 + \dots + v_n) \xrightarrow{n \rightarrow \infty} \mathcal{U} \cdot \mathcal{V} \Rightarrow \sum_{j=1}^{\infty} w_j = \mathcal{U} \cdot \mathcal{V}$$

10. Билет 10

10.1. Понятия функциональных последовательностей и рядов.

Определение: [функциональная последовательность]:

Пусть $X \subset \mathbb{R}$ — произвольное множество.

$$\forall n \in \mathbb{N} \leftrightarrow y = f_n(x), x \in X$$

Множество занумерованных функций $f_1, f_2 \dots f_n \dots$ называют функциональной последовательностью, где

f_n — член последовательности
 X — область определения

Определение: [функциональный ряд]:

сумма

$$\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x) = f_1(x) + \dots + f_n(x) + \dots$$

членов функциональной последовательности $\{f_n(x)\}_{k=1}^{\infty}$ называется функциональным рядом.

Замечание: изучение функциональных рядов эквивалентно изучению функциональных последовательностей:

1. Каждому функциональному ряду

$$\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$$

соответствует функциональная последовательность его частичных сумм

$$\{S_n(x) = \sum_{k=1}^n f_k(x)\}_{n=1}^{\infty}$$

2. Каждой функциональной последовательности $\{S_n(x)\}_{k=1}^{\infty}$ соответствует функциональный ряд с членами $f_1(x) = S_1(x)$, $f_2(x) = S_2(x) - S_1(x) \dots$, $f_n(x) = S_n(x) - S_{n-1}(x)$, \dots

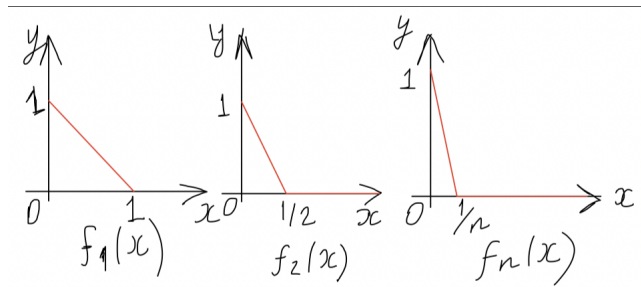
Примеры:

1.

$$f_n(x) = \begin{cases} 1 - nx & , 0 \leq x \leq \frac{1}{n} \\ 0 & , \frac{1}{n} < x \leq 1 \end{cases}$$

$$2. 1 + \sum_{k=1}^{\infty} \frac{x^k}{k!} = 1 + \frac{x}{1!} + \dots + \frac{x^n}{n!} + \dots$$
$$S_{n+1}(x) = 1 + \frac{x}{1!} + \dots + \frac{x^n}{n!}$$

$S_{n+1}(x)$ отличается от e^x по формуле Маклорена с остаточным членом в форме Лагранжа на $R_{n+1}(x) = \frac{e^{\theta x}}{(n+1)!} x^{n+1}$, $0 < \theta < 1$



10.2. Сходимость функциональных рядов и последовательностей в точке и на множестве.

Определение: [сходимость в точке]:

Зафиксируем точку $x_0 \in X$ и рассмотрим числовую последовательность $\{f_n(x_0)\}_{n=1}^{\infty}$. Если указанная последовательность сходится, то функциональную последовательность $\{f_n(x)\}_{n=1}^{\infty}$ называют сходящейся в точке x_0 .

Замечание: аналогичное верно и для функциональных рядов: Если числовой ряд $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x_0)$ сходится, то функциональный ряд $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$ называют сходящимся в точке x_0 .

Определение: [область сходимости]:

Множество точек в которых сходится функциональная последовательность (или функциональный ряд) называют областью сходимости функциональной последовательности (функционального ряда).

Замечание: область сходимости функциональной последовательности(ряда) может совпадать с его областью определения X , составлять его части или быть \emptyset .

Определение: [предельная функция]:

Пусть $\tilde{X} \subset X$ — область сходимости функциональной последовательности $\{f_n(x)\}_{n=1}^{\infty}$, совокупность пределов, взятых в точке $x \in \tilde{X}$ определяет на \tilde{X} функцию $y = f(x)$. Эта функция называется предельной функцией $y = f(x)$ функциональной последовательности.

Определение: [сумма ряда]:

Пусть $\tilde{X} \subset X$ — область сходимости функционального ряда $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$, совокупность пределов, взятых в точке $x \in \tilde{X}$ определяет на \tilde{X} функцию $y = S(x)$. Эта функция называется суммой ряда $y = S(x)$ функциональной последовательности.

10.3. Понятие равномерной сходимости на множестве.

Определение: [равномерная сходимость функциональной последовательности]:

Функциональная последовательность $\{f_n(x)\}_{n=1}^{\infty}$ сходится равномерно к функции $y = f(x)$ на множестве X если:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon): \forall n \geq N \ \& \ \forall x \in X \mapsto |f_n(x) - f(x)| < \varepsilon$$

(-): $\exists \varepsilon_0 > 0 : \forall n \exists n_0 \geq n \ \& \ \exists x_n \in X : |f_{n_0}(x_n) - f(x_n)| \geq \varepsilon_0$

Обозначение: $f_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} f(x)$

Примеры:

1.

$$f_n(x) = \begin{cases} 1 - nx & , 0 \leq x \leq \frac{1}{n} \\ 0 & , \frac{1}{n} < x \leq 1 \end{cases}$$

$$f(x) = \begin{cases} 0 & , 0 \leq x < 1 \\ 1 & , x = 1 \end{cases}$$

$$\forall \varepsilon > 0 \exists n_0 = n \ \& \ x_n = \frac{1}{2n} : \\ f(x_n) = 0, f_n(x_n) = \frac{1}{2} \\ |f_n(x_n) - f(x_n)| = \varepsilon_0$$

2.

$$f_n(x) = \begin{cases} 1 - nx & , \delta \leq x \leq \frac{1}{n} \\ 0 & , \frac{1}{n} < x \leq 1 \end{cases}$$

Для заданного $\delta > 0 \exists N \mapsto$

$$f_n(x) \equiv 0 \text{ на } [\delta, 1]$$

$$f(x) \equiv 0 \text{ на } [\delta, 1]$$

Тогда $f_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in [\delta, 1]} 0$.

Замечания:

1. N в определении не зависит от x , а только от ε . Один номер для всех $x \in X$ одновременно.
2. Из сходимости функциональной последовательности $\{f_n(x)\}_{n=1}^{\infty}$ в каждой точке $x \in X$ НЕ следует равномерная сходимость на X .

Замечание: Если $f_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} f(x)$, то $f_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X'} f(x)$, где $X' \subset X$.

$$f_n(x) = \begin{cases} 1 - nx & , \delta \leq x \leq \frac{1}{n} \\ 0 & , \frac{1}{n} < x \leq 1 \end{cases}$$

Определение: [равномерная сходимость функционального ряда]:

Функциональный ряд

$$\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$$

равномерно сходится к $S(x)$ на множестве X , если $S_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} S(x)$

10.4. Критерий Коши равномерной сходимости.

Теорема [Критерий Коши для функциональной последовательности]: Функ-

циональная последовательность $f_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} f(x)$ сходится тогда и только тогда, когда выполнено условие Коши равномерной сходимости функциональной последовательности:

$$[\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon): \forall n \geq N \ \& \ \forall p \in \mathbb{N} \ \forall x \in X \mapsto |f_{n+p}(x) - f_n(x)| < \varepsilon]$$

Доказательство:

1. *Необходимость* \Rightarrow :

$$f_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} f(x)$$

Тогда:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon): \forall n \geq N \ \& \ x \in X \mapsto |f_n(x) - f(x)| < \varepsilon/2$$

Тогда и

$$\forall p \in \mathbb{N} \ |f_{n+p}(x) - f(x)| < \varepsilon/2$$

Воспользуемся правилом треугольника:

$$|f_{n+p}(x) - f_n(x)| \leq |f_{n+p}(x) - f(x)| + |f_n(x) - f(x)| < \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon}{2} = \varepsilon$$

2. *Достаточность* \Leftarrow :

$$[\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon): \forall n \geq N \ \& \ \forall p \in \mathbb{N} \ \& \ \forall x \in X \mapsto |f_{n+p}(x) - f_n(x)| < \varepsilon]$$

Зафиксируем $x \in X$, тогда $\exists f(x)$ — предельное значение последовательности $\{f_n(x)\}_{n=1}^{\infty}$.

$$\text{Тогда } f_{n+p}(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} f(x)$$

В неравенстве перейдем к предельному при $p \rightarrow \infty$:

$$\forall n \geq N \ \& \ \forall x \in X \Rightarrow |f_n(x) - f(x)| \leq \frac{\varepsilon}{2} < \varepsilon$$

Тогда получим, что $f_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} f(x)$ по определению.

Теорема [Критерий Коши для функционального ряда]:

Ряд

$$\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} S(x)$$

тогда и только тогда, когда выполнено условие Коши:

$$[\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon): \forall n \geq N \ \& \ \forall p \in \mathbb{N} \ \& \ \forall x \in X \mapsto$$

$$\left| \sum_{k=n+1}^{n+p} f_k(x) \right| < \varepsilon]$$

Замечание: критерий Коши для функциональных рядов следует из критерия Коши для функциональных последовательностей, так как:

$$\left| \sum_{k=n+1}^{n+p} f_k(x) \right| = |S_{n+p}(x) - S_n(x)|$$

Отрицание условия Коши:

Для функциональной последовательности:

$$\exists \varepsilon_0 > 0: \forall n \exists n_0 \geq n \ \& \ \exists p_0 \in \mathbb{N} \ \& \ \exists x_n \in X : |f_{n_0+p_0}(x_n) - f_{n_0}(x_n)| \geq \varepsilon_0$$

Для функционального ряда:

$$\exists \varepsilon_0 > 0: \forall n \exists n_0 \geq n \ \& \ \exists x_n \in X : \left| \sum_{k=n+1}^{n+p} f_k(x) \right| \geq \varepsilon_0$$

10.5. Критерии равномерной сходимости функциональной последовательности и функционального ряда.

Теорема 1 [sup-критерий для функциональной последовательности]:

$$f_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} f(x) \text{ тогда и только тогда, когда}$$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sup_X |f_n(x) - f(x)| = 0$$

Доказательство:

$$\text{Обозначим } M_n = \sup_{x \in X} |f_n(x) - f(x)|.$$

Тогда запишем наше равенство в виде:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \mapsto 0 \leq M_n < \varepsilon$$

1. *Необходимость* \Rightarrow :

$$[f_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} f(x)] \stackrel{def}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \ \& \ \forall x \in X \mapsto |f_n(x) - f(x)| < \frac{\varepsilon}{2}]$$

$$\text{Отсюда, } M_n \leq \frac{\varepsilon}{2} < \varepsilon$$

2. *Достаточность* \Leftarrow :

$$\forall x \in X \mapsto |f_n(x) - f(x)| \leq M_n$$

То есть:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \ \& \ \forall x \in X \mapsto |f_n(x) - f(x)| < \varepsilon$$

Теорема 2 [sup-критерий для функционального ряда]:

Функциональный ряд $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$ равномерно сходится к $S(x)$ на множестве X тогда и только тогда, когда

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sup_{x \in X} |r_n(x)| = 0$$

Доказательство:

$$r_n(x) = \sum_{k=1}^{\infty} f_k(x) - \sum_{k=1}^n f_k(x) = \sum_{k=n+1}^{\infty} f_k(x)$$

То есть $r_n(x) = S(x) - S_n(x)$

Но $S_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} S(x)$ тогда и только тогда, когда $r_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} 0$.

Примеры:

1. $f_n(x) = nx^2 e^{-nx}$, $x \in [2, +\infty) \subset X$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{nx^2}{e^{nx}} = 0 \Rightarrow y = f(x) \equiv 0$$

$$f'_n(x) = nx(2 - nx)e^{-nx} = 0$$

$x_n = \frac{2}{n}$ — точка максимума, при $x > \frac{2}{n}$, $n > 1 \Rightarrow f'_n(x) < 0 \Rightarrow f_n$ убывает на X ;

$$\sup_X f_n(x) \leq f\left(\frac{2}{n}\right) = \frac{4}{ne^2} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$$

Отсюда, $f_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in X} 0$.

2. $f_n(x) = n^2 x^2 e^{-nx}$, $X = (0, 2)$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{n^2 x^2}{e^{nx}} = 0$$

$$\Rightarrow y = f(x) \equiv 0$$

$$f'_n(x) = n^2 x(2 - nx)e^{-nx} = 0$$

$x_n = \frac{2}{n}$, $n > 1$ — точка максимума. \Rightarrow

$$\sup_X f_n(x) = \frac{4}{e^2} \not\xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$$

3.

$$f_n(x) = \frac{\ln(nx)}{\sqrt{nx}}, X = (0, 1)$$

$$\forall n \exists n_0 = n \ \& \ \exists p_0 = n \ \& \ \exists x_n = \frac{1}{n}$$

$$|f_{2n}(x_n) - f_n(x_n)| = \left| \frac{\ln 2}{\sqrt{2}} - \frac{\ln 1}{\sqrt{1}} \right| = \frac{\ln 2}{\sqrt{2}} > \varepsilon_0 = \frac{\ln 2}{2\sqrt{2}}$$

Отсюда, равномерной сходимости нет.

10.6. Свойства равномерно сходящихся последовательностей и рядов.

Теорема 1: если члены функционального ряда

$$\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$$

непрерывны на $[a, b]$ и ряд сходится равномерно на $[a, b]$ к функции $y = S(x)$, то сумма ряда $y = S(x)$ непрерывна на $[a, b]$.

Доказательство:

$$[S_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{x \in [a, b]} S(x)] \stackrel{def}{=} [\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon): \forall n \geq N \ \& \ \forall x \in [a, b] \mapsto |S_n(x) - S(x)| < \frac{\varepsilon}{3}]$$

Возьмем $n_0 \geq N \Rightarrow |S_{n_0}(x) - S(x)| < \frac{\varepsilon}{3}$

При $x_0 \in [a, b]$ выполняется:

$$|S_{n_0}(x_0) - S(x_0)| < \frac{\varepsilon}{3}$$

В силу непрерывности f_k на $[a, b]$, S_{n_0} непрерывна на $[a, b]$, в частности в точке $x_0 \in [a, b]$, то есть:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \delta = \delta(\varepsilon): \forall x \in [a, b]: |x - x_0| < \delta \mapsto |S_{n_0}(x) - S_{n_0}(x_0)| < \frac{\varepsilon}{3}$$

$$\forall x \in [a, b]: |x - x_0| < \delta \mapsto$$

$$|S(x) - S(x_0)| = |[S(x) - S_{n_0}(x)] + [S_{n_0}(x) - S_{n_0}(x_0)] + [S_{n_0}(x_0) - S(x_0)]| \leq |S(x) - S_{n_0}(x)| + |S_{n_0}(x) - S_{n_0}(x_0)| + |S_{n_0}(x_0) - S(x_0)| < \frac{\varepsilon}{3} \cdot 3 = \varepsilon$$

В силу произвольности выбора точки $x_0 \in [a, b]$ функция $y = S(x)$ непрерывна на $[a, b]$.

Теорема 1': если члены функциональной последовательности $\{f_n(x)\}_{n=1}^{\infty}$ в каждой точке $x \in X$ непрерывны на $[a, b]$ и последовательность сходится равномерно на $[a, b]$ к функции $f(x)$, то $y = f(x)$ непрерывна на $[a, b]$.

Замечание: пусть ряд

$$\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$$

удовлетворяет условиям теоремы 1 и $S(x) = \sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$.

$$\forall x_0 \in [a, b] \mapsto \lim_{x \rightarrow x_0} S(x) = S(x_0)$$

Отсюда,

$$\lim_{x \rightarrow x_0} \sum_{k=1}^{\infty} f_k(x) = \sum_{k=1}^{\infty} \lim_{x \rightarrow x_0} f_k(x)$$

При выполнении условий теоремы 1 возможен почленный переход к пределу под знаком суммы для равномерно сходящегося функционального ряда, члены которого есть непрерывные функции.

Теорема 2: если члены функционального ряда $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$ непрерывны на $[a, b]$ и ряд сходится равномерно на $[a, b]$ к функции $y = S(x)$, то функциональный ряд $\sum_{k=1}^{\infty} \int_a^x f_k(t) dt$

также сходится равномерно на $[a, b]$ к функции $y = \int_a^x S(t) dt$.

Доказательство: $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$ сходится равномерно на $[a, b]$ к $y = S(x)$:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon): \forall n \geq N \ \& \ \forall x \in [a, b] \mapsto |S_n(x) - S(x)| < \frac{\varepsilon}{b-a}$$

По теореме 1 S непрерывна на $[a, b]$, следовательно S и f_k — интегрируемые функции ($\forall k$) на $[a, b]$. Обозначим:

$$I(x) = \int_a^x S(t) dt$$

и

$$I_n(x) = \sum_{k=1}^{\infty} \int_a^x f_k(t) dt = \int_a^x \left[\sum_{k=1}^{\infty} f_k(t) \right] dt = \int_a^x S_n(t) dt$$

$$|I(x) - I_n(x)| = \left| \int_a^x [S(t) - S_n(t)] dt \right| \leq \int_a^x |S_n(t) - S(t)| dt \leq \frac{\varepsilon}{b-a} (x-a) < \varepsilon$$

Итак:

$\forall \varepsilon > 0 \exists N = N(\varepsilon): \forall n \geq N \ \& \ \forall x \in [a, b] \mapsto |I(a) - I_n(x)| < \varepsilon$, то есть функциональный ряд

$$\sum_{k=1}^{\infty} \int_a^x f_k(t) dt$$

сходится равномерно на $[a, b]$ к функции

$$\int_a^x S(t) dt = \int_a^x \left[\sum_{k=1}^{\infty} f_k(t) \right] dt$$

и

$$\sum_{k=1}^{\infty} \int_a^x f_k(t) dt = \int_a^x \left[\sum_{k=1}^{\infty} f_k(t) \right] dt$$

Теорема 2’: если члены функциональной последовательности $\{f_n(x)\}_{n=1}^{\infty}$ непрерывны на $[a, b]$. и $f_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{[a, b]} f(x)$, то $\int_a^x f_n(t) dt \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{[a, b]} \int_a^x f(t) dt$.

Замечания:

1. В теоремах 2, 2’ отрезок $[a, x]$ можно заменить отрезком $[x_0, x] \subset [a, b]$.
2. Теоремы 2 и 2’ остаются справедливыми, если функции $y = f_k(x)$ интегрируемы на $[a, b]$.

Теорема 3: если члены функционального ряда $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$ непрерывно-дифференцируемы на $[a, b]$ и функциональный ряд $\sum_{k=1}^{\infty} f'_k(x)$ сходится равномерно на $[a, b]$, а числовой ряд $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x_0)$ ($x_0 \in [a, b]$) сходится, то функциональный ряд $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$ сходится равномерно на $[a, b]$ к функции $y = S(x)$ и $S'(x) = \sum_{k=1}^{\infty} f'_k(x)$

Доказательство:

Обозначим:

$$\tilde{S}(x) = \sum_{k=1}^{\infty} f'_k(x)$$

Из условия теорем 3 и 1 $y = \tilde{S}(x)$ непрерывна на $[a, b]$.

Ряд $\sum_{k=1}^{\infty} f'_k(x)$ можно почленно интегрировать (по теореме 2), то есть:

$$\int_{x_0}^x \tilde{S}(t)dt = \sum_{k=1}^{\infty} \left[\int_{x_0}^x f'_k(t)dt \right]$$

Согласно теореме 2 ряд сходится равномерно на $[a, b]$.

Но $\int_{x_0}^x f'_k(t)dt = f_k(x) - f_k(x_0)$, следовательно:

$$\sum_{k=1}^{\infty} \left[\int_{x_0}^x f'_k(t)dt \right] = \sum_{k=1}^{\infty} f_k(x) - \sum_{k=1}^{\infty} f_k(x_0)$$

Ряды слева и справа равномерно-сходящиеся, а значит, $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$ сходится равномерно на $[a, b]$.

$$\int_{x_0}^x \tilde{S}(t)dt = S(x) - S(x_0)$$

Левая часть – интеграл с переменным верхним пределом и его производная равна $\tilde{S}(x)$
 \Rightarrow правая часть – дифференцируемая функция и $S'(x) = \tilde{S}(x)$, то есть

$$\left(\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x) \right)' = \sum_{k=1}^{\infty} f'_k(x)$$

Замечания:

1. По условию теоремы 3: $\tilde{S}(x) = S'(x)$ – непрерывная функция $\Rightarrow S$ – непрерывно-дифференцируемая на $[a, b]$.
2. Теорема 3 остается справедливой, если функции $y = f_k(x)$ являются дифференцируемыми функциями.

Теорема 3': если члены функциональной последовательности $\{f_n(x)\}_{n=1}^{\infty}$ являются непрерывно-дифференцируемыми функциями на $[a, b]$, числовая последовательность $\{f_n(x_0)\}_{n=1}^{\infty}$ сходится, где $x_0 \in [a, b]$; а функциональная последовательность $\{f'_n(x)\}_{n=1}^{\infty}$ равномерно сходится на $[a, b]$, то $\{f_n(x)\}_{n=1}^{\infty}$ сходится равномерно на $[a, b]$ к функции $y = f(x)$ и справедливо равенство

$$f'(x) = \lim_{n \rightarrow \infty} f'_n(x), x \in [a, b]$$

Замечание: можно сделать важный вывод: равномерная сходимость не выводит из класса непрерывных функций, а в случае равномерной сходимости производных – из класса непрерывно дифференцируемых функций.

10.7. Достаточные признаки сходимости функциональных рядов.

Теорема 1 [Признак Вейерштрасса]:

Если для функционального ряда

$$\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$$

можно указать такой числовой ряд с неотрицательными членами $\sum_{k=1}^{\infty} a_k < \infty$, что $\forall k \geq k_0$ и $\forall x \in X$ выполняется: $0 \leq |f_k(x)| \leq a_k$, то функциональный ряд

$$\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$$

сходится абсолютно и равномерно на X .

Доказательство:

$$\sum_{k=1}^{\infty} a_k < \infty \Leftrightarrow \forall \varepsilon > 0 \exists N_1 = N_1(\varepsilon): \forall n \geq N_1 \ \& \ \forall p \in \mathbb{N} \mapsto \sum_{k=n+1}^{n+p} a_k < \varepsilon$$

$$\exists N = \max\{N_1, k_0\} \Rightarrow \forall n \geq N \ \& \ \forall x \in X \ \& \ \forall p \in \mathbb{N} \mapsto$$

$$\left| \sum_{k=n+1}^{n+p} f_k(x) \right| \leq \sum_{k=n+1}^{n+p} |f_k(x)| \leq \sum_{k=n+1}^{n+p} a_k < \varepsilon$$

Следствие: если сходится числовой ряд

$$\sum_{k=1}^{\infty} a_k,$$

где $a_k = \sup_{x \in X} |f_k(x)|$, то функциональный ряд $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$ сходится абсолютно и равномерно на X .

Теорема 2 [Признак Дирихле]: Если:

1.

$$\sum_{k=1}^{\infty} u_k(x)$$

имеет равномерно ограниченную на X последовательность частичных сумм $\{S_n(x)\}_{n=1}^{\infty}$:

$$\exists M > 0: \forall x \in X \ \& \ \forall n \in \mathbb{N} \mapsto |S_n(x)| \leq M$$

2. $\sum_{k=1}^{\infty} v_k(x)$ монотонна на X и $v_k(x) \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{x \in X} 0$:

$$\begin{aligned} v_k(x) &\leq v_{k+1}(x) \ \forall x \in X \ \& \ \forall k \\ [v_k(x) &\geq v_{k+1}(x)] \end{aligned}$$

то $\sum_{k=1}^{\infty} u_k v_k$ сходится равномерно на X .

Теорема 2 [Признак Абеля]: Если:

1. $\sum_{k=1}^{\infty} u_k(x)$ равномерно сходится на X .

2. $\{v_k(x)\}_{k=1}^{\infty}$ равномерно ограничена и монотонна на X .

то $\sum_{k=1}^{\infty} u_k v_k$ сходится равномерно на X .

11. Билет 11

11.1. Степенные ряды с комплексными числами

Определение: $\sum_{k=0}^{\infty} c_k(\zeta - a)$; $c_k, a \in \mathbb{C}$ — фиксированные числа, $\zeta \in \mathbb{C}$ — переменная.

Такой функциональный ряд называется *степенным*.

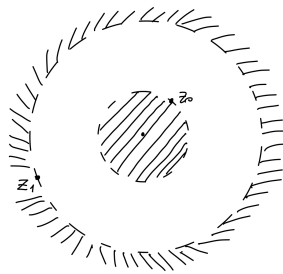
c_k — коэф. степенного ряда. Этот ряд сходится в точке a .

$\zeta - a = z \Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k$ — будем рассматривать такой степенной ряд, который сходится в т. $z = 0$

11.2. Теорема 1. [Первая теорема Абеля]

1. Если степенной ряд $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k$ сходится в т. $z \neq 0$, то он сходится в круге: $K = \{z \in \mathbb{C} : |z| < |z_0|\}$

2. Если степенной ряд $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k$ расходится в т. z_1 , то он расходится в любой т. $z : |z| > |z_1|$



$$\left[\lim_{n \rightarrow \infty} z_n = a \right] \stackrel{\text{def}}{=} \left[\lim_{n \rightarrow \infty} |z_n - a| = 0 \right]$$

$$\forall \varepsilon > 0 \quad \exists N = N(\varepsilon) : \forall n \geq N \Rightarrow |z_n - a| < \varepsilon$$

Доказательство:

1) $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z_0^k < \infty \Rightarrow c_k z_0^k \xrightarrow{k \rightarrow \infty} 0 \Rightarrow$ Ограничена: $\exists M > 0 : \forall k \Rightarrow |c_k z_0^k| \leq M$

$\forall z : |z| < |z_0|$

$$|c_k z^k| = |c_k z_0^k| \left(\frac{z}{z_0} \right)^k \leq M \cdot [q(z)]^k, |q(z)| < 1 \Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} q^k(z) < \infty \Rightarrow$$

$$\Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} |c_k z^k| < \infty \Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k$$

2) $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z_1^k = \infty \Rightarrow \forall z : |z| > |z_1|$ — ряд $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k$ расходится, если бы в точке $z_2 :$

$|z_2| > |z_1|$ ряд $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z_2^k < \infty \stackrel{1)}{\Rightarrow} \sum_{k=0}^{\infty} c_k z_1^k < \infty$ — противоречие.

Следствие 1. Если $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z_0^k < \infty, z_0 \neq 0$, то $\forall \rho : 0 < \rho < |z_0|$ в круге $k_\rho = \{z \in \mathbb{C} :$

$|z| \leq \rho\}$ ряд $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k$ сходится равномерно.

Доказательство:

$$\exists M > 0 : \forall k \Rightarrow |c_k z_0^k| \leq M$$

$$\forall z \in K_\rho$$

$$|c_k z^k| = |c_k z_0^k \cdot \frac{z^k}{z_0^k}| \leq M \left(\frac{\rho}{|z_0|} \right)^k = M \cdot q^k$$

$$|q| = \frac{\rho}{|z_0|} < 1 \left(\frac{\rho}{|z_0|} \text{ не зависит от } z \right),$$

$$\sum_{k=0}^{\infty} q^k < \infty \xRightarrow{\text{По пр. Вей.}} \sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k \text{ сходится равномерно в круге } K_\rho$$

Следствие 2 Если в т. $z_0 \neq 0$ вып. $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z_0^k < \infty$, то

- 1) $\sum_{k=m}^{\infty} c_k z^{k-m}$ сходится абсолютно в круге K_0 и равномерно в круге K_ρ
- 2) $\sum_{k=1}^{\infty} k c_k z^{k-1}$ сходится абсолютно в круге K_0 и равномерно в круге K_ρ

Доказательство:

$$1) \forall z \in K_0 \Rightarrow |c_k z^{k-m}| = |c_k z_0^k| \left(\frac{z}{z_0} \right)^{k-m} \cdot \frac{1}{z_0^m} \leq$$

$$\frac{M}{|z_0|^m} \cdot \left| \frac{z}{z_0} \right|^{k-m} = \frac{M}{|z_0|^m} \cdot q^{k-m}(z), \quad q(z) = \left| \frac{z}{z_0} \right| < 1$$

$$\sum_{k=m}^{\infty} q^{k-m} < \infty - \text{сходится абсолютно в } K_0$$

$$\forall z \in K_1 \Rightarrow |c_k z^{k-m}| \leq \frac{M}{|z_0|^m} \cdot q_1^{k-m}, \quad q_1 = \frac{\rho}{|z_0|} < 1.$$

$0 < q_1 < 1$ - не зависит от $z \Rightarrow$ по признаку Вейр. в K_1 ряд сходится равномерно

2) $\forall z \in K_0$

$$|k c_k z^{k-1}| = \left| \frac{c_k z_0^k}{z_0} \cdot k \left(\frac{z}{z_0} \right)^{k-1} \right| \leq \frac{M}{|z_0|} \cdot k q^{k-1}(z), \quad q(z) = \left| \frac{z}{z_0} \right| < 1$$

$$\sum_{k=1}^{\infty} k q^k(z) < \infty \text{ по признаку Даламбера}$$

11.3. Теорема 2. [О радиусе сходимости степенного ряда].

Для любого степенного ряда существует R ($R \geq 0$ или $R = +\infty$) такое, что

1) $0 < R < \infty \Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k < \infty$ в круге $K = \{z \in \mathbb{C} : |z| < R\}$ и расходится в $\mathbb{C} \setminus \overline{K}$

2) $R = 0$, то $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k < \infty$ только в $z = 0$

3) $R = +\infty$, то $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k < \infty \forall z \in \mathbb{C}$

R - называется радиусом сходимости степенного ряда $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k$

K - круг сходимости.

Доказательство: Пусть $\mathcal{D} \subset \mathbb{C}$ - множество сходимости степенного ряда; $\mathcal{D} \neq \emptyset$, т.к. $0 \in \mathcal{D}$

1) \mathcal{D} - огран., $z_0 \in \mathcal{D}, z_0 \neq 0$

$R = \sup_{z \in \mathcal{D}} |z|$ - сущ. т.к. \mathcal{D} огранич. мн-во.

Докажем: $\forall z \in K \Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k < \infty$

$\forall z \in \mathbb{C} \setminus \overline{K} \Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k = \infty$

По определению $\sup \forall z' \in K \exists z_1 \in \mathcal{D} : |z'| < |z_1| \leq R$, т.к.

$\sum_{k=0}^{\infty} c_k z_1^k < \infty \Rightarrow$ 1-я теорема Абеля $\sum_{k=0}^{\infty} c_k (z')^k < \infty$ и сходится абсолютно \Rightarrow В силу

произв. $z' \in K \Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k$ сходится абс. в круге K

Пусть $z' \notin K \Rightarrow |z'| > R \Rightarrow$ по опред. $\sup z' \notin \mathcal{D} \Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} c_k (z')^k = \infty \Rightarrow$ расходится вне круга K

2) \mathcal{D} - огран.; если $\mathcal{D} = \{0\}$, то ряд сход в т. $z = 0$ и расх в $z \neq 0$

$\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k < \infty \quad z = 0 \quad \Rightarrow R = 0$

3) \mathcal{D} - неогранич. $\Rightarrow \forall z \in \mathbb{C} \exists z' \in \mathcal{D} :$

$|z| < |z'|, \sum_{k=0}^{\infty} c_k (z')^k < \infty \xrightarrow{1\text{-я т. Аб.}} \sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k < \infty.$

11.4. Теорема 3. [Вторая теорема Абеля].

Если $0 < R < +\infty$, R - радиус сходимости $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k$ и $\sum_{k=0}^{\infty} c_k R^k < \infty$, то на $[0, R]$ ряд $\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k$ сх. равномерно и его сумма $S(x) = \sum_{k=0}^{\infty} c_k x^k$ непрерывна $\forall x \in [0, R]$

Доказательство: $\sum_{k=0}^{\infty} \underbrace{c_k R^k}_{U_k} \cdot \underbrace{\left(\frac{x}{R}\right)^k}_{V_k}$

1) $\sum_{k=0}^{\infty} c_k R^k < \infty$

2) $V_k = \left(\frac{x}{R}\right)^k \quad 0 \leq V_k \leq 1 \quad \forall x \in [0; R]$

$V_{k+1} = \left(\frac{x}{R}\right)^{k+1} < \left(\frac{x}{R}\right)^k = V_k \quad \forall k$

\Downarrow признак Абеля

$\sum_{k=0}^{\infty} c_k x^k < \infty$ сходится равномерно на $[0, R]$

$f_k(x) = c_k x^k$ - непрерывна на $[0; R]$

$S(x) = \sum_{k=0}^{\infty} c_k x^k$ непрерывна на $[0; R]$

11.5. Теорема 4.

$$\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k$$

$$1) \lim_{k \rightarrow \infty} \sqrt[k]{|c_k|} = \rho \quad (\rho \geq 0, \rho = +\infty) \Rightarrow R = \frac{1}{\rho}$$

$$2) \text{ Если } |c_k| > 0 \quad \forall k \text{ и } \lim_{k \rightarrow \infty} \frac{|c_{k+1}|}{|c_k|} = \rho \quad (\rho \geq 0, \rho = +\infty) \Rightarrow R = \frac{1}{\rho}.$$

Доказательство:

$$K = \{z \in \mathbb{C} : |z| < \frac{1}{\rho}\}$$

$$z_0 \in K : \sqrt[k]{|c_k z_0^k|} = |z_0| \sqrt[k]{|c_k|} \xrightarrow{k \rightarrow \infty} |z_0| \cdot \rho < \frac{1}{\rho} \cdot \rho = 1$$

\Downarrow По признаку Коши

$$\sum_{k=0}^{\infty} |c_k z_0^k| < \infty$$

$$z_1 : |z_1| > \frac{1}{\rho}$$

$$\sqrt[k]{|c_k z_1^k|} = |z_1| \sqrt[k]{|c_k|} \xrightarrow{k \rightarrow \infty} |z_1| \cdot \rho > \frac{1}{\rho} \cdot \rho \Rightarrow \text{По признаку Коши } \sum_{k=0}^{\infty} c_k z_1^k = \infty.$$

Пример (показывает, для чего нужна формула Коши-Адамара):

$$\sum_{k=1}^{\infty} z^{k^2} = z + z^4 + z^9 + z^{16} + z^{25} + \dots + z^{k^2} + \dots$$

$$\{c_k\} = \{c_1 = 1, c_2 = c_3 = 0, c_4 = 1, c_5 = c_6 = c_7 = c_8 = 0, c_9 = 1, \dots\}$$

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \sqrt[k]{|c_k|} = \lim_{k \rightarrow \infty} \sqrt[k^2]{|c_{k^2}|} = 1 \Rightarrow R = 1.$$

11.6. Теорема 5. [Формула Коши-Адамара].

$$\text{Если } R - \text{радиус сходимости } \sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k, \text{ тогда } R = \frac{1}{\lim_{k \rightarrow \infty} \sqrt[k]{|c_k|}}.$$

Доказательство: 1) $\{\sqrt[k]{|c_k|}\}$ - неогр.

$$2) \overline{\lim}_{k \rightarrow \infty} \sqrt[k]{|c_k|} = L > 0; \quad L \in R$$

$$3) \underline{\lim}_{k \rightarrow \infty} \sqrt[k]{|c_k|} = 0 \Rightarrow \{\sqrt[k]{|c_k|}\} \text{ сходится к } 0$$

1) Для бескон. числа номеров $k \in \mathbb{N}$

$$|c_k z^k| > 1 \quad \forall z \neq 0, z \in \mathbb{C}$$

\Downarrow

Не выполняется необходимое условие сходимости ряда

\Downarrow

$$\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k = \infty$$

\Downarrow

$$\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k < \infty \quad \text{только для } z = 0$$

2) Докажем, что

а) $\forall z : |z| < \frac{1}{L}$ ряд сходится

б) $\forall z : |z| < \frac{1}{L}$ ряд расходится

а) $z : |z| < \frac{1}{L}$ Тогда $\exists \varepsilon > 0 : |z| < \frac{1}{L+\varepsilon} < \frac{1}{L}$

$$\varepsilon > 0 \exists k_0(\varepsilon) : \forall k \geq k_0 \Rightarrow \sqrt[k]{|c_k|} < L + \frac{\varepsilon}{2}$$

$$\sqrt[k]{|c_k z^k|} = |z| \sqrt[k]{|c_k|} \leq \frac{L+\frac{\varepsilon}{2}}{L+\varepsilon}$$

↓ По признаку Коши

$$\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k < \infty \quad \text{в круге } K = \{z : |z| < \frac{1}{L}\}$$

$$6) \forall z : |z| > \frac{1}{L} \Rightarrow \exists \varepsilon > 0 : |z| > \frac{1}{L-\varepsilon} > \frac{1}{L}$$

$$[\exists \{c_{k_n}\} : \lim_{n \rightarrow \infty} \sqrt[k]{|c_{k_n}|} = L] \stackrel{\text{def}}{=} [\varepsilon > 0 \exists n_0 : \forall n \geq n_0 \Rightarrow L - \varepsilon < \sqrt[k_n]{|c_{k_n}|}]$$

$$\sqrt[k_n]{|c_{k_n}|} z^{k_n} = |z| \sqrt[k_n]{|c_{k_n}|} > \frac{1}{L-\varepsilon} \cdot (L - \varepsilon) = 1 \quad \forall n \geq n_0 \Rightarrow |c_k z^{k_n}| > 1 \Rightarrow$$

⇒ Не выполняются необходимых условий сходимости

↓

Ряд расходится $\forall z : |z| > \frac{1}{L}$

$$3) \lim_{k \rightarrow \infty} \sqrt[k]{|c_k|} = 0 \Rightarrow \{\sqrt[k]{|c_k|}\} \text{ сходится к } 0.$$

$$\forall z \in \mathbb{C}, z \neq 0 : \frac{1}{2|z|} = \varepsilon : \exists k_0(\varepsilon) : \forall k \geq k_0 \Rightarrow \sqrt[k]{|c_k|} < \frac{1}{2|z|} \Rightarrow$$

$$\Rightarrow \sqrt[k]{|c_k|} \cdot |z^k| = |z| \sqrt[k]{|c_k|} < |z| \cdot \frac{1}{2|z|} = \frac{1}{2} < 1$$

↓ По признаку Коши

$$\sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k < \infty \quad \forall z \in \mathbb{C}$$

11.7. Теорема 6.

Для рядов

$$\begin{array}{lll} \sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k, & \sum_{k=0}^{\infty} \frac{c_k z^{k+1}}{k+1}, & \sum_{k=0}^{\infty} k c_k z^{k-1} \\ 1) & 2) & 3) \end{array}$$

радиус сходимости один и тот же.

$$1) R_1, K_1$$

$$2) R_2, K_2$$

$$3) R_3, K_3$$

Надо доказать: $R_1 = R_2 = R_3 = R$.

$$\text{Доказательство: } \forall k \in \mathbb{N} \Rightarrow \frac{1}{k+1} < 1 \leq k \quad \times |c_k z^{k+1}|$$

$$|\frac{c_k}{k+1} z^{k+1}| \leq |z| \cdot |c_k z^k| \leq |z|^2 \cdot |k c_k z^{k-1}|$$

$$\underbrace{|z| \cdot |c_k z^k| \leq |z|^2 \cdot |k c_k z^{k-1}|}_{1)} \quad \underbrace{|\frac{c_k}{k+1} z^{k+1}| \leq |z| \cdot |c_k z^k|}_{2)}$$

$$1) \forall z \neq 0 \in K_3 \Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} c_k z^k < \infty \Rightarrow R_1 \geq R_3$$

$$2) \forall z \neq 0 \in K_1 \Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} \frac{c_k}{k+1} z^{k+1} < \infty \Rightarrow R_1 \leq R_2$$

В результате: $R_3 \leq R_1 \leq R_2$

Надо доказать, что $R_2 \leq R_3$

$$z \in K_2 \quad \exists \rho < R_2 : z \in K_\rho \quad |k c_k z^{k-1}| = |k c_k z^{k-1} \cdot \frac{k+1}{k+1} \cdot \frac{z^2}{z^2}| = |\frac{c_k}{k+1} \cdot z^{k+1} \cdot \frac{k(k+1)}{z^2}| =$$

$$|\frac{c_k}{k+1} \cdot \rho^{k+1} \cdot \frac{k(k+1)}{z^2}| \cdot \left(\frac{z}{\rho}\right)^{k+1} \stackrel{\exists M > 0}{\leq}$$

$$\leq \frac{M}{|z|^2} k(k+1) \rho_1^{k+1}, \text{ где } |q_1| < 1 \quad q_1 = \frac{z}{\rho}$$

$$\Downarrow \forall z \in K_2 \Rightarrow \sum_{k=0}^{\infty} k c_k z^{k-1} < \infty \Rightarrow R_3 \geq R_2$$

Тогда в сумме $R_1 = R_2 = R_3 = R$

11.8. Теорема 7.

Если R - радиус степенного ряда $\sum_{k=0}^{\infty} a_k(x-a)^k = f(x)$,

$x \in (a-R; a+R)$; $a_k, a, x \in R$, то

1) f бесконечно дифф. на $(a-R; a+R)$

$$f^{(m)}(x) = \sum_{k=m}^{\infty} k(k-1)\dots(k-(m-1))a_k(x-a)^{k-m}$$

$$2) \forall x \in (a-R; a+R) \Rightarrow \int_a^x f(t)dt = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{a_k}{k+1}(x-a)^{k+1}$$

При почленном дифференцировании ряда радиус не меняется.

Доказательство: $\forall \rho : 0 < \rho < R$ на $[a-\rho; a+\rho]$ равномерная сходимость \Rightarrow всё можно делать.

Следствие: $a_k = \frac{f^{(k)}(a)}{k!}$

12. Билет 12

12.1. Степенные ряды с действительными членами.

Теорема: Если R – радиус сходимости степенного ряда и выполнено следующее:

$$\sum_{k=0}^{\infty} a_k (x - a)^k = f(x), \quad x \in (a - R, a + R), \quad a_k, a \in (R)$$

то

1. f бесконечно дифференцируемая функция на $(a - R, a + R)$ и выполняется:

$$f^{(m)}(x) = \sum_{k=m}^{+\infty} k(k-1) \dots (k-(m-1)) a_k (x-a)^{k-m}$$

2. $\forall x \in (a - R, a + R) \mapsto \int_a^x f(t) dt = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{a_k}{k+1} (x-a)^{k+1}$

Следствие. $a_n = \frac{f^{(n)}(a)}{n!}$

12.2. Бесконечная дифференцируемость суммы степенного ряда на интервале сходимости.

Покажем, что сумма степенного ряда дифференцируема в интервале сходимости.

Теорема: Сумма степенного ряда $f(x) = \sum_{n=0}^{\infty} c_n (x - x_0)^n$ дифференцируема в интервале сходимости и производная равна

$$f'(x) = \sum_{n=1}^{\infty} n c_n (x - x_0)^{n-1},$$

причём ряды $\sum_{n=1}^{\infty} n c_n (x - x_0)^{n-1}$ и $\sum_{n=0}^{\infty} c_n (x - x_0)^n$ имеют одинаковый радиус сходимости.

Доказательство. Члены ряда $c_n (x - x_0)^n$ являются непрерывно дифференцируемыми на всей числовой прямой функциями. Пусть $R = \frac{1}{\lim_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n]{|c_n|}}$ радиус сходимости ряда $\sum_{n=0}^{\infty} c_n (x - x_0)^n$ и точка x принадлежит интервалу сходимости $(x_0 - R, x_0 + R)$. Тогда существует отрезок $[a, b] \subset (x_0 - R, x_0 + R)$, включающий точку x .

Рассмотрим ряд $\sum_{n=1}^{\infty} n c_n (x - x_0)^{n-1}$, полученный почленным дифференцированием ряда $\sum_{n=0}^{\infty} c_n (x - x_0)^n$. Вычислим его радиус сходимости R'

$$R' = \frac{1}{\lim_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n-1]{|n c_n|}} = \frac{1}{\lim_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n-1]{|c_n|} \cdot \sqrt[n-1]{n}} = \frac{1}{\lim_{n \rightarrow \infty} (|c_n|^{\frac{1}{n}})^{\frac{n}{n-1}}} = R$$

Таким образом, ряды $\sum_{n=1}^{\infty} n c_n (x - x_0)^{n-1}$ и $\sum_{n=0}^{\infty} c_n (x - x_0)^n$ имеют одинаковый интервал сходимости, и, следовательно, на отрезке $[a, b]$ ряд $\sum_{n=1}^{\infty} n c_n (x - x_0)^{n-1}$ сходится равномерно.

По теореме о дифференцируемости суммы функционального ряда сумма степенного ряда $f(x)$ дифференцируема в точке x и верна формула

$$f'(x) = \sum_{n=1}^{\infty} n c_n (x - x_0)^{n-1}$$

что полностью доказывает теорему. \square

Теперь в силу доказанной теоремы при дифференцировании суммы степенного ряда вновь получаем степенной ряд с тем же радиусом сходимости. Это позволяет нам сформулировать следующую теорему:

Теорема. Сумма степенного ряда $f(x) = \sum_{n=0}^{\infty} c_n (x - x_0)^n$ дифференцируема любое количество раз и верна формула

$$f^{(k)}(x) = \sum_{n=k}^{\infty} c_n n(n-1)(n-2) \dots (n-k+1) (x - x_0)^{n-k}$$

причём радиусы сходимости всех получающихся рядов одинаковы.

Доказательство. По предыдущей теореме функция $f(x) = \sum_{n=0}^{\infty} c_n (x - x_0)^n$ дифференцируема и $f'(x) = \sum_{n=1}^{\infty} n c_n (x - x_0)^{n-1}$, причём радиусы сходимости обоих рядов совпадают. Далее, пусть существует

$$f^{(k-1)}(x) = \sum_{n=k-1}^{\infty} c_n n(n-1)(n-2) \dots (n-k+2) (x - x_0)^{n-k+1}$$

Применяя к функции $f^{(k-1)}(x)$ предыдущую теорему, получаем, что $f^{(k-1)}(x)$ дифференцируема и верна формула

$$f^{(k)}(x) = (f^{(k-1)}(x))' = \sum_{n=k}^{\infty} c_n n(n-1)(n-2) \dots (n-k+2)(n-k+1) (x - x_0)^{n-k},$$

причём радиусы сходимости рядов для $f^{(k-1)}(x)$ и $f^{(k)}(x)$ совпадают. Тем самым, следуя методу математической индукции, полностью доказывает эту теорему. \square

12.3. Единственность представления функции степенным рядом.

Определение: Регулярная функция.

Пусть в каждой точке $z \in \mathbb{E}$, где \mathbb{E} – множество точек комплексной плоскости, поставлено в соответствие комплексное число ω . На множестве \mathbb{E} определена функция комплексного переменного, $\omega = f(z)$.

Если $\forall \epsilon > 0 \exists \sigma = \sigma_\epsilon > 0 : \forall z : |z - a| < \sigma_\epsilon \implies |f(z) - f(a)| < \epsilon$, то функцию $f(z)$ называют непрерывной в точке a .

И, наконец, Функция комплексного переменного $f(z)$ называется регулярной в точке a , если она определена в некоторой окрестности точки a и представима в некотором круге $|z - a| < \rho$, $\rho > 0$, сходящимся к $f(z)$ степенным рядом $f(z) = \sum_{n=0}^{\infty} c_n (z - a)^n$ (*).

Теорема [Единственность представления функции степенным рядом]:

Функция $f(z)$, регулярная в точке a , единственным образом представляется рядом (*).

Доказательство. Пусть функция $f(z)$ имеет два представления в виде степенного ряда в круге $K = \{z : |z - a| < \rho\}$, где $\rho > 0$, т.е.

$$f(z) = \sum_{n=0}^{\infty} c_n(z-a)^n = \sum_{n=0}^{\infty} \tilde{c}_n(z-a)^n \quad (**)$$

Теперь покажем, что $c_n = \tilde{c}_n$, для $n = 0, 1, 2, \dots$

По условию ряды $\sum_{n=0}^{\infty} c_n(z-a)^n$ и $\sum_{n=0}^{\infty} \tilde{c}_n(z-a)^n$ сходятся в круге K , и поэтому эти ряды сходятся равномерно в круге $K_1 = \{z : |z-a| \leq \rho_1 < \rho\}$, а их общая сумма – непрерывная в круге K_1 функция. В частности, функция $f(z)$ непрерывна в точке a . Подходя к пределу при $z \rightarrow a$ в равенстве (**), получаем $c_0 = \tilde{c}_0$. Отбрасывая одинаковые слагаемые c_0 и \tilde{c}_0 в равенстве (**), получаем после деления на $(z-a)$ равенство:

$$c_1 + c_2(z-a) + c_3(z-a)^2 + \dots = \tilde{c}_1 + \tilde{c}_2(z-a) + \tilde{c}_3(z-a)^2 + \dots,$$

которое справедливо в круге K с выколотой точкой a . Ряды в левой и правой части сходятся равномерно в круге K_1 . Переходя в равенстве к пределу при $z \rightarrow a$, получаем $c_1 = \tilde{c}_1$. Справедливость равенства $c_n = \tilde{c}_n$ при любой $n \in (N)$ устанавливается при помощи индукции.

12.4. Достаточные условия разложимости бесконечно дифференцируемой функции в степенной ряд

Теорема [Достаточные условия сходимости ряда Тейлора к функции]:

Если f бесконечно дифференцируемая функция на $(a-\delta, a+\delta)$, $\delta > 0$ и $\exists M > 0 : \forall x \in (a-\delta, a+\delta) \mapsto |f^{(k)}(x)| \leq M$, $k = 0, 1, \dots$, то ряд Тейлора сходится к функции $f(x)$ в каждой точке x нашего интервала:

$$f(x) = f(a) + \sum_{k=1}^{\infty} \frac{f^{(k)}(a)}{k!} (x-a)^k, \quad \forall x \in (a-\delta, a+\delta)$$

Доказательство. Достаточные условия разложимости бесконечно дифференцируемой функции в степенной ряд.

$$r_n(x) = \frac{f^{(n+1)}(\xi)}{(n+1)!} (x-a)^{n+1}, \quad \text{где } \xi \text{ между } x \text{ и } a$$

$$|r_n(x)| \leq M \cdot \frac{|x-a|^{n+1}}{(n+1)!}$$

т.к. $|x-a| \geq 0 \Rightarrow \lim_{k \rightarrow \infty} \frac{|x-a|^k}{k!} = 0$, тогда справедливо следующее:

$$\forall x \in (a-\delta, a+\delta) \quad \forall n \in \mathbb{N} \mapsto |r_n(x)| \leq M \cdot \frac{|x-a|^{n+1}}{(n+1)!} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0 \quad \square.$$

12.5. Ряд Тейлора

Пусть функция f – бесконечно дифференцируема в точке a (т.е. в этой точке у функции f существует производная любого порядка), тогда

Определение. Рядом Тейлора функции f в точке a называется следующее выражение:

$$f(a) + \sum_{k=1}^{\infty} \frac{f^{(k)}(a)}{k!} (x-a)^k$$

Замечание. Если функция регулярна в точке a , то она раскладывается в степенной ряд и этот степенной ряд и есть ряд Тейлора, однако не все функции раскладываются в степенной ряд, поэтому справедливо следующее выражение:

$$f(x) \neq f(a) + \sum_{k=1}^{\infty} \frac{f^{(k)}(a)}{k!} (x-a)^k$$

Пример. Рассмотрим следующую функцию:

$$f(x) = \begin{cases} e^{-\frac{1}{x^2}}, & x \neq 0; \\ 0, & x = 0. \end{cases}$$

Эта функция непрерывная в нуле. Найдём ее производные:

$$f'(x) = \frac{2}{x^3} \cdot e^{-\frac{1}{x^2}}$$

$$f''(x) = \left[\left(\frac{2}{x^3} \right)^2 - \frac{6}{x^4} \right] \cdot e^{-\frac{1}{x^2}}$$

$$f'''(x) = \left[\left(\frac{2}{x^3} \right)^3 - \frac{12}{x^7} - \frac{2^4}{x^4} + \frac{24}{x^5} \right] \cdot e^{-\frac{1}{x^2}}$$

Таким образом $f^{(m)}(x) = Q_{3m}(\frac{1}{x}) \cdot e^{-\frac{1}{x^2}}$, где $Q_{3m}(\frac{1}{x})$ – многочлен степени $3m$ от $\frac{1}{x}$. Тогда понятно, что

$$\lim_{x \rightarrow 0} \frac{e^{-\frac{1}{x^2}}}{x^k} = 0 \Rightarrow$$

$$\Rightarrow f^{(m)}(x) = \begin{cases} Q_{3m}(\frac{1}{x}) \cdot e^{-\frac{1}{x^2}}, & x \neq 0; \\ 0, & x = 0. \end{cases}$$

Тогда $\forall x \neq a$ ряд Тейлора будет представлять собой нулевой ряд, хотя сама функция не нулевая $\Rightarrow f(x) \neq f(a) + \sum_{k=1}^{\infty} \frac{f^{(k)}(a)}{k!} (x-a)^k$. \square

12.6. Формула Тейлора с остаточным членом в интегральной форме.

Функция f – бесконечно дифференцируема в некоторой окрестности точки a , тогда этой функции соответствует некоторый ряд:

$$f(a) + \sum_{k=1}^{\infty} \frac{f^{(k)}(a)}{k!} (x-a)^k$$

Обозначение. $P_n(x) = f(a) + \sum_{k=1}^n \frac{f^{(k)}(a)}{k!} (x-a)^k$ – n -ая частичная сумма ряда Тейлора (многочлен Тейлора).

Тогда, если $r_n(x) = f(x) - P_n(x) \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$, то это означает, что ряд Тейлора сходится к функции f в точке x :

$$f(x) = f(a) + \sum_{k=1}^{\infty} \frac{f^{(k)}(a)}{k!} (x-a)^k$$

Теорема: Если $f^{(n+1)}$ непрерывна на $(a-\delta, a+\delta)$, $\delta > 0$, то:

1. $r_n(x) = \frac{1}{n!} \int_a^x (x-t)^n f^{(n+1)}(t) dt$, т.е. её остаточный член на этом интервале представим в интегральной форме.
2. $r_n(x) = \frac{f^{(n+1)}(\xi)}{(n+1)!} (x-a)^{n+1}$

Доказательство.

1. Доказательство будем проводить при помощи мат. индукции:

(а) Мы знаем, что $f(x) - f(a) = \int_a^x f'(t) dt$. Тогда:

$$\begin{cases} u = f'(t), & dv = dt \\ du = f''(t) dt, & v = -(x-t), \text{ x - это константа} \end{cases}$$

$$\text{получаем, что } f(x) - f(a) = -f'(t)(x-t) \Big|_a^x + \int_a^x (x-t)f''(t) dt =$$

$$= f'(a)(x-a) + \frac{1}{1!} \int_a^x (x-t)f''(t) dt \Rightarrow$$

$$\Rightarrow f(x) = f(a) + \frac{f'(a)}{1!} (x-a) + \frac{1}{1!} \int_a^x (x-t)f''(t) dt.$$

Получили при $n = 1$ остаточный член в интегральной форме (получена база индукции).

- (б) Предположим, что при $n-1$ верно, тогда найдем для n :

$$f(x) = f(a) + \sum_{k=1}^{n-1} \frac{f^{(k)}(a)}{k!} (x-a)^k + \frac{1}{(n-1)!} \int_a^x (x-t)^{n-1} f^{(n)}(t) dt$$

Тогда:

$$\begin{cases} u = f^n(t), & dv = (x-t)^{n-1} dt \\ du = f^{n+1}(t) dt, & v = -\frac{(x-t)^n}{n} \end{cases}$$

$$\text{получаем, что } f(x) = f(a) + \sum_{k=1}^{n-1} \frac{f^{(k)}(a)}{k!} (x-a)^k - \frac{(x-t)^n f^{(n)}(t)}{n!} \Big|_a^x + \frac{1}{n!} \int_a^x (x-t)^n f^{(n+1)}(t) dt.$$

Тогда получаем, что:

$$f(x) = f(a) + \sum_{k=1}^n \frac{f^{(k)}(a)}{k!} (x-a)^k + \frac{1}{n!} \int_a^x (x-t)^n f^{(n+1)}(t) dt \quad \square$$

2. Это просто остаточный член в форме Лагранжа (доказывалось в прошлом семестре).

13. Билет 13

13.1. Разложение в ряд Тейлора основных элементарных функций: e^x , $\cos x$, $\sin x$, $\ln(1+x)$, $(1+x)^\alpha$.

1. Показательная и гиперболические функции.

$$y = e^x, \quad x \in \mathbb{R}$$

$$x \in (-\rho, \rho), \quad \rho > 0$$

Поскольку $(e^x)^{(k)} = e^x$, то $0 < f(x) < e^\rho$ и $0 < f(x)^{(k)} < e^\rho$. Ряд Тейлора функции $y = e^x$ сходится к ней на $(-\rho, \rho)$ по теореме о достаточном условии представимости функции её рядом Тейлора.

$$\forall \rho > 0 \Rightarrow R = +\infty$$

$$e^x = \sum_{k=0}^{+\infty} \frac{x^k}{k!}$$

$$y = \operatorname{sh} x, \quad y = \operatorname{ch} x, \quad x \in \mathbb{R}$$

$$\operatorname{sh} x = \frac{e^x - e^{-x}}{2}, \quad \operatorname{ch} x = \frac{e^x + e^{-x}}{2}$$

$$\operatorname{sh} x = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{x^{2k+1}}{(2k+1)!}, \quad \operatorname{ch} x = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{x^{2k}}{(2k)!}, \quad R = +\infty$$

2. Тригонометрические функции.

$$y = \sin x, \quad y = \cos x, \quad x \in \mathbb{R}$$

$$|f^{(k)}(x)| \leq 1, \quad \forall k = 0, 1, 2, \dots$$

$$\sin x = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(-1)^k x^{2k+1}}{(2k+1)!}, \quad \cos x = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(-1)^k x^{2k}}{(2k)!}, \quad R = +\infty$$

3. Степенная функция.

$$y = (1+x)^\alpha, \quad \alpha \in \mathbb{R}$$

1) $\alpha = 0, \quad y = 1$

2) $\alpha = n, \quad n \in \mathbb{N}, \quad f(x) = \sum_{k=0}^{\infty} C_n^k x^k$ - бином Ньютона

3) α - произвольное, $\alpha \in \mathbb{R}$

$$f^{(n+1)}(x) = \alpha(\alpha-1)\dots(\alpha-n)(1+x)^{\alpha-(n+1)}$$

$$r_n(x) = \frac{\alpha(\alpha-1)\dots(\alpha-n)}{n!} \int_0^x \left(\frac{x-t}{1+t} \right)^n (1+t)^{\alpha-1} dt$$

Пусть $t = x\tau$, $0 \leq \tau \leq 1$, тогда $dt = x d\tau$

$$r_n(x) = \frac{\alpha(\alpha-1)\dots(\alpha-n)}{n!} x^{n+1} \int_0^1 \left(\frac{1-\tau}{1+x\tau} \right)^n (1+x\tau)^{\alpha-1} d\tau$$

Пусть $|x| < 1$, тогда $|1+\tau x| \geq 1-\tau$

$$(1+x\tau)^{\alpha-1} \leq \beta(x) = \begin{cases} (1+|x|)^{\alpha-1}, & \alpha \geq 1 \\ (1-|x|), & \alpha < 1 \end{cases}$$

$|\alpha| \leq m$, $m \in \mathbb{N}$. Тогда $\forall n > m$

$$\left| \frac{\alpha(\alpha-1)\dots(\alpha-n)}{n!} \right| \leq \frac{m(m+1)\dots(m+n)}{n!} \leq \frac{(m+n)!}{n!} = (n+1)(n+2)\dots(n+m) \leq (2n)^m$$

В итоге

$$|r_n(x)| \leq 2^m \beta(x) |x| \frac{n^m}{\left(\frac{1}{|x|} \right)^n} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0$$

Так как

$$a = \frac{1}{|x|} > 1 \quad \lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{n^m}{a^n} = 0$$

Следовательно

$$(1+x)^\alpha = \sum_{k=0}^{\infty} C_\alpha^k x^k, \quad C_\alpha^k = \frac{\alpha(\alpha-1)\dots(\alpha-(k-1))}{k!}, \quad |x| < 1, \quad R = 1$$

В частности:

$$\frac{1}{1-x} = \sum_{k=0}^{\infty} x^k, \quad \frac{1}{1+x} = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k x^k, \quad |x| < 1$$

4. Логарифмические функции.

$$y = \ln(1-x), \quad y' = -\frac{1}{1-x} = -\sum_{k=0}^{\infty} x^k$$

$$y = \ln(1+x), \quad y' = \frac{1}{1+x} = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k x^k$$

Раскладываем в интервалах сходимости каждую функцию в ряд Тейлора, а потом почленно интегрируем, и помним, что при почленном интегрировании радиус сходимости не меняется.

$$y = \ln(1-x) = -\sum_{k=0}^{\infty} \frac{x^{k+1}}{k+1} = -\sum_{k=1}^{\infty} \frac{x^k}{k}, \quad |x| < 1$$

$$y = \ln(1+x) = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(-1)^k x^{k+1}}{k+1} = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k-1} x^k}{k}, \quad |x| < 1$$

5. Обратные тригонометрические функции.

Обратные тригонометрические функции можно разложить в ряд Тейлора, сначала продифференцировав и воспользовавшись известными результатами.

13.2. Разложение в степенной ряд комплекснозначной функции e^z .

Докажем, что

$$e^z = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{z^k}{k!}, \quad R = +\infty$$
$$\cos z = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(-1)^k z^{2k}}{(2k)!}, \quad \sin z = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(-1)^k z^{2k+1}}{(2k+1)!}, \quad R = +\infty$$

Доказательство:

Так как $z = x + iy$ и по формуле Эйлера: $e^{i\varphi} = \cos(\varphi) + i \sin(\varphi)$, то

$$e^z = e^{x+iy} = e^x (\cos y + i \sin y)$$

$$e^x = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{x^k}{k!}, \quad \cos y = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{y^{2k}}{(2k)!}, \quad \sin y = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{y^{2k+1}}{(2k+1)!}$$

$$e^{iy} = \cos y + i \sin y = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{y^{2k}}{(2k)!} + i \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{y^{2k+1}}{(2k+1)!} =$$
$$= \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(iy)^{2k}}{(2k)!} + \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(iy)^{2k+1}}{(2k+1)!} = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(iy)^k}{k!} = e^{iy}$$

$$e^z = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{x^k}{k!} \cdot \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(iy)^k}{k!}$$

Докажем, что

$$\sum_{k=0}^{\infty} \frac{(z_1 + z_2)^k}{k!} = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{z_1^k}{k!} \cdot \sum_{k=0}^{\infty} \frac{z_2^k}{k!}$$

$$\sum_{k=0}^{\infty} \frac{(z_1 + z_2)^k}{k!} = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!} \cdot \sum_{j=0}^k C_k^j z_1^j z_2^{k-j} = \sum_{k=0}^{\infty} \sum_{j=0}^k \frac{1}{k!} \cdot \frac{k!}{j! \cdot (k-j)!} z_1^j z_2^{k-j} =$$
$$= \sum_{k=0}^{\infty} \sum_{j=0}^k \frac{z_1^j}{j!} \cdot \frac{z_2^{k-j}}{(k-j)!} = \frac{z_1^0}{0!} \cdot \frac{z_2^0}{0!} + \left(\frac{z_1^0}{0!} \cdot \frac{z_2^1}{1!} + \frac{z_1^1}{1!} \cdot \frac{z_2^0}{0!} \right) +$$
$$+ \left(\frac{z_1^0}{0!} \cdot \frac{z_2^2}{2!} + \frac{z_1^1}{1!} \cdot \frac{z_2^1}{1!} + \frac{z_1^2}{2!} \cdot \frac{z_2^0}{0!} \right) + \dots$$

Это можно проиллюстрировать следующим образом:

Мы обходим таблицу по диагоналям, так что сумма индексов элементов была константа для каждой группы слагаемых. Тогда действительно:

	u_0	u_1	u_2	u_3	\dots
v_0	$u_0 \cdot v_0$	$u_1 \cdot v_0$	$u_2 \cdot v_0$	\dots	
v_1	$u_0 \cdot v_1$	$u_1 \cdot v_1$	\dots		
v_2	$u_0 \cdot v_2$	\dots			
v_3	\dots				
\dots					

$$\sum_{k=0}^{\infty} \frac{(z_1 + z_2)^k}{k!} = \sum_{k=0}^{\infty} \sum_{j=0}^k \frac{z_1^j}{j!} \cdot \frac{z_2^{k-j}}{(k-j)!} = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{z_1^k}{k!} \cdot \sum_{k=0}^{\infty} \frac{z_2^k}{k!}$$

Тогда по доказанной выше лемме:

$$e^z = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{x^k}{k!} \cdot \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(iy)^k}{k!} = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(x + iy)^k}{k!} = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{z^k}{k!}$$

Теперь

$$\begin{aligned} e^{iz} &= \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(iz)^k}{k!} = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(iz)^{2k}}{(2k)!} + \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(iz)^{2k+1}}{(2k+1)!} = \\ &= \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{z^{2k}}{(2k)!} + i \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{z^{2k+1}}{(2k+1)!} \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} e^{-iz} &= \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(-iz)^k}{k!} = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(-iz)^{2k}}{(2k)!} + \sum_{k=0}^{\infty} \frac{(-iz)^{2k+1}}{(2k+1)!} = \\ &= \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{z^{2k}}{(2k)!} - i \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{z^{2k+1}}{(2k+1)!} \end{aligned}$$

$$\frac{e^{iz} + e^{-iz}}{2} = \cos z = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{z^{2k}}{(2k)!}$$

$$\frac{e^{iz} - e^{-iz}}{2} = \sin z = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{z^{2k+1}}{(2k+1)!}$$

Что и требовалось доказать.