

Mehrdimensionale Differenzierbarkeit

Für $z := (z_1, \dots, z_k) \in \mathbb{R}^k$ bezeichnen

$$pr_i : \mathbb{R}^k \rightarrow \mathbb{R}$$

$$pr_i(z) := \langle e_i, z \rangle_2 = z_i$$

die Projektionen auf die i -te Koordinate.

Mehrdimensionale Differenzierbarkeit

Für zwei Funktionen $g : U \subset \mathbb{R}^n \rightarrow V \subset \mathbb{R}^m$ und
 $f : V \subset \mathbb{R}^m \rightarrow W \subset \mathbb{R}^l$ bezeichnet

$$f \circ g : U \rightarrow W$$

$$(f \circ g)(x) := f(g(x))$$

die Hintereinanderausführung (Verkettung) von f und g .

Mehrdimensionale Differenzierbarkeit

Eine Funktion $F : U \subset \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$ ist genau dann differenzierbar, wenn alle Koordinatenfunktionen

$$F_i : U \subset \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$$

$$F_i(x) := (pr_i \circ F)(x) := pr_i(F(x))$$

differenzierbar sind.

Beweis

Betrachte $dF = (dF_1, \dots, dF_m)$ zusammen mit dem Restglied $R(h) = (R_1(h), \dots, R_m(h))$ definiert jeweils durch die rechte oder linke Seite.

Kettenregel

Sind $g : U \subset \mathbb{R}^n \rightarrow V \subset \mathbb{R}^m$ und $f : V \subset \mathbb{R}^m \rightarrow W \subset \mathbb{R}^l$ differenzierbar, so ist $g \circ f$ differenzierbar und es gilt

$$d(f \circ g)(a) = df(b) \cdot dg(a)$$

mit $b = g(a)$.

Beweis

Nach Voraussetzung gilt

$$g(a + h) = g(a) + dg(a)h + \|h\|r_1(h); \quad \lim_{h \rightarrow 0} r_1(h) = 0$$

$$f(b + k) = f(b) + df(b)k + \|k\|r_2(k); \quad \lim_{k \rightarrow 0} r_2(k) = 0$$

Beweis Kettenregel

Einsetzen ergibt

$$(f \circ g)(a + h) = (f \circ g)(a) + (df(b) \cdot dg(a))h + R(h)$$

mit $R(h) := \|h\|df(b)r_1(h) + \|k\|r_2(k)$ und
 $k = dg(a)h + \|h\|r_1(h)$.

Beweis Kettenregel

Müssen nur noch zeigen, dass $\lim_{h \rightarrow 0} \frac{R(h)}{\|h\|} = 0$ gilt.

Beweis Kettenregel

Da $dg(a)$ eine lineare Abbildung ist, gibt es ein $c \in \mathbb{R}$ mit

$$\|k\| \leq \|h\|(c + \|r_1(h)\|)$$

womit die Behauptung folgt.

Satz von Schwarz

Wenn Für eine Funktion $f : U \rightarrow \mathbb{R}$ die Ableitungen $\frac{\partial}{\partial x_i} f(a)$, $\frac{\partial}{\partial x_j} f(a)$ und $\frac{\partial}{\partial x_i} \frac{\partial}{\partial x_j} f(a)$ existieren und letztere stetig ist, dann existiert auch $\frac{\partial}{\partial x_j} \frac{\partial}{\partial x_i} f(a)$ und es gilt

$$\frac{\partial}{\partial x_i} \frac{\partial}{\partial x_j} f(a) = \frac{\partial}{\partial x_j} \frac{\partial}{\partial x_i} f(a)$$

Bedeutung

Die Reihenfolge spielt beim wiederholten ableiten keine Rolle.

\mathcal{C}^k -Funktionen

Eine Funktion $f : U \rightarrow \mathbb{R}$ für die alle partiellen Ableitungen

$$\frac{\partial}{\partial x_{i_1}} \cdots \frac{\partial}{\partial x_{i_k}} f(a)$$

mit $i_1, \dots, i_k \leq k$ existieren und stetig sind heißt \mathcal{C}^k -Funktion oder k -mal stetig differenzierbar.

\mathcal{C}^k -Funktionen

Eine \mathcal{C}^1 -Funktion ist also eine differenzierbare Funktion.

p-te Ableitung

Für eine Funktion $f : U \rightarrow \mathbb{R}$, $a \in U$ und Vektoren $v^1, \dots, v^p \in \mathbb{R}^n$ heißt

$$d^p f(a)(v^1, \dots, v^p) := \partial_{v^1} \dots \partial_{v^p} f(a)$$

die p -te Richtungsableitung von f . Sie ist wegen dem Satz von Schwarz wohldefiniert.

$$d^p f(a)(v^1, \dots, v^p) = \sum_{i_1=1}^n \dots \sum_{i_p=1}^n \frac{\partial}{\partial x_{i_1}} \dots \frac{\partial}{\partial x_{i_p}} f(a) \cdot v_{i_1}^1 \dots v_{i_p}^p.$$

Für einen Vektor $z \in \mathbb{R}^n$ definieren wir

$$d^p f(a)z^p := d^p f(a) \underbrace{(z, \dots, z)}_{p\text{-mal}}.$$

Hessematrix

Für $p = 2$ und $u, v \in \mathbb{R}^n$ ist

$$d^2 f(a)(u, v) = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n \frac{\partial}{\partial x_i} \frac{\partial}{\partial x_j} f(a) v_i u_j$$

und mit

$$f''(a) := \begin{pmatrix} \frac{\partial}{\partial x_1} \frac{\partial}{\partial x_1} f(a) & \cdots & \frac{\partial}{\partial x_1} \frac{\partial}{\partial x_n} f(a) \\ \vdots & & \vdots \\ \frac{\partial}{\partial x_n} \frac{\partial}{\partial x_1} f(a) & \cdots & \frac{\partial}{\partial x_n} \frac{\partial}{\partial x_n} f(a) \end{pmatrix}$$

ist $d^2 f(a)(u, v) = u^T \cdot f''(a) \cdot v$. Die Matrix $f''(a)$ wird auch Hesse-Matrix genannt. Nach dem Satz von Schwarz ist sie symmetrisch.

Taylorapproximation

Sei $f : U \rightarrow \mathbb{R}$ eine \mathcal{C}^{p+1} -Funktion und $x, a \in U$, so dass die Verbindung zwischen x und a in U liegt. Dann gilt

$$f(x) = f(a) + \sum_{k=1}^p \frac{1}{k!} d^k f(a)(x-a)^k + R_{p+1}(x; a)$$

mit dem Restglied $R_{p+1}(x; a) := \frac{1}{(p+1)!} d^{p+1} f(\xi)(x-a)^{p+1}$ für ein $\xi \in [a, x]$.

Beispiel

Wiki

Beweis

Sei $F(t) := f(a + th)$ mit $t \in [0, 1]$. Wiederholte Anwendung der Kettenregel mit $\gamma(t) := a + th$ und $F(t) = f(\gamma(t))$ ergibt

$$F'(t) = \sum_{i=1}^n \frac{\partial}{\partial x_i} f(a + th) h_i$$

$$F''(t) = \sum_{j=1}^n \sum_{i=1}^n \frac{\partial}{\partial x_j} \frac{\partial}{\partial x_i} f(a + th) h_i h_j$$

\vdots

$$F^p(t) = \sum_{i_1=1}^n \cdots \sum_{i_p=1}^n \frac{\partial}{\partial x_{i_1}} \cdots \frac{\partial}{\partial x_{i_p}} f(a + th) h_{i_1} \cdots h_{i_p}.$$

Beweis

Mit der Taylorapproximation für Funktionen einer Veränderlichen folgt für $h := (x - a)$

$$F(1) = F(0) + F'(0) + \frac{1}{2!}F''(0) + \cdots + \frac{1}{p!}F^p(0) + R_{p+1}$$

mit dem Restglied $R_{p+1} := \frac{1}{(p+1)!}F^{p+1}(\tau)$ mit $\tau \in [0, 1]$. Da nach Konstruktion $F(0) = f(a)$ und $F(1) = f(x)$ folgt insgesamt die Behauptung.

Taylorapproximation

Sei $T_p(x, a) = f(a) + \sum_{k=1}^p \frac{1}{k!} d^k f(a)(x - a)^k$ die Taylorapproximation einer \mathcal{C}^p -Funktion. Dann gilt:

$$\lim_{x \rightarrow a} \frac{f(x) - T_p(x; a)}{\|x - a\|^p} = 0 .$$

Bedeutung

Die Taylorapproximation vom Grad p konvergiert polynominell vom Grad p gegen 0.

Beweis

Da die partiellen Ableitungen stetig sind, gibt es für jedes $\epsilon > 0$ ein Radius $r > 0$, dass für alle $y \in K_r(a)$

$$\frac{1}{p!}(d^p f(y) - d^p f(a))h^p \leq \epsilon \|h\|_\infty^p.$$

Mit der Taylorapproximation ist

$$\begin{aligned} f(x) &= T_{p-1}(x, a) + \frac{1}{p!} d^p f(\xi)(x - a)^p \\ &= T_p(x, a) + \frac{1}{p!} (d^p f(\xi) - d^p f(a)) h^p (x - a)^p \end{aligned}$$

Mit obiger Abschätzung folgt die Behauptung.

Extrema

Sei $f : X \subset \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ eine reelle Funktion. Ein Punkt $a \in X$ heißt lokales Maximum bzw. Minimum, falls eine Umgebung U von a existiert, so dass $f(x) \leq f(a)$ bzw. $f(x) \geq f(a)$ für alle $x \in U$ gilt. Liegt einer der beiden Fälle vor, so spricht man von einem lokalen Extremum. Gilt strikt $f(x) < f(a)$ bzw. $f(x) > f(a)$, so nennt man das Extremum isoliert. Ist $U = X$ so nennt man es auch globales Maximum bzw. Minimum.

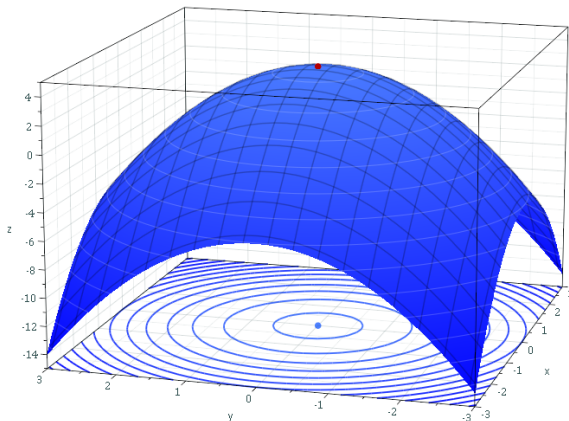


Figure: Quelle: Wikipedia:

<https://en.wikipedia.org/wiki/File:MaximumParaboloid.png>

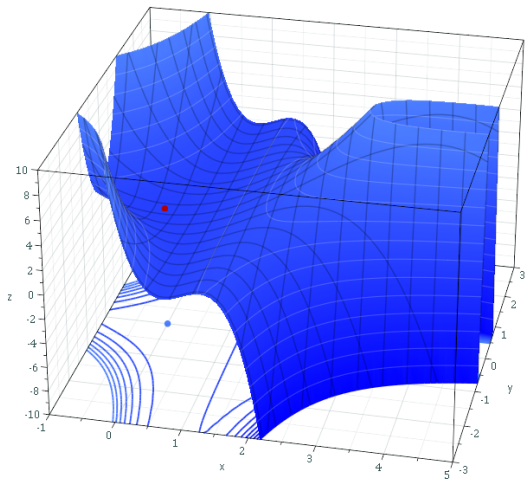


Figure: Quelle: Wikipedia:

<https://en.wikipedia.org/wiki/File:MaximumCounterexample.png>

Extrema

Ist $f : U \rightarrow \mathbb{R}$ differenzierbar und hat f in $a \in U$ ein lokales Extremum, so gilt

$$\frac{\partial}{\partial x_1} f(a) = \dots = \frac{\partial}{\partial x_n} f(a) = 0 .$$

Sind die partiellen Ableitungen stetig, ist dies gleichbedeutend mit $df(a) = 0$.

Kritischer Punkt

Ein Punkt a mit $df(a) = 0$ wird kritischer Punkt genannt.

Beweis

Setze $F_k(t) := f(a + te_k)$. Da f ein Extremum in a hat, hat F_k in einer hinreichend kleinen Umgebung um 0 ein Extremum. Da F_k eine Funktion einer Veränderlichen ist, gilt $F'_k(0) = 0$. Da $\frac{\partial}{\partial x_k} f(a) = F'_k(0)$ folgt die Behauptung.

Extrema

Ist $f : U \rightarrow \mathbb{R}$ eine \mathcal{C}^2 -Funktion und ist $f'(a) = 0$ für ein $a \in U$.
Dann gilt:

- $f''(a) > 0 \Rightarrow f$ hat in a ein isoliertes lokales Minimum.
- $f''(a) < 0 \Rightarrow f$ hat in a ein isoliertes lokales Maximum.
- $f''(a) \geq 0 \Rightarrow f$ hat in a einen Sattelpunkt.

Extrema

$f''(a) > 0 \Leftrightarrow x^t f''(a) x > 0 \quad \forall x \in \mathbb{R}^n \Leftrightarrow$ alle Eigenwerte sind positiv \Leftrightarrow Alle Hauptminoren sind positiv .

Extrema

$f''(a) < 0 \Leftrightarrow x^t f''(a) x < 0 \quad \forall x \in \mathbb{R}^n \Leftrightarrow$ alle Eigenwerte sind negativ \Leftrightarrow Alle Hauptminoren sind alternierend.

Beweis

Sei $f'(a) = 0$ und $f''(a) > 0$. Mit der Taylorformel gilt für hinreichend kurze Vektoren $h \in \mathbb{R}^n$

$$f(a + h) = f(a) + \frac{1}{2} h^T f''(a) h + R(h)$$

mit $\lim_{h \rightarrow 0} \frac{R(h)}{\|h\|} = 0$. Für $\|h\| \leq 1$ hat $h^T f''(a) h$ sein Maximum m auf dem Einheitskreis $\{h \in \mathbb{R}^n \mid \|h\| = 1\}$ da $f''(a) > 0$.

$$h^T f''(a) h = \|h\| \frac{1}{\|h\|} h^T f''(a) \|h\| \frac{1}{\|h\|} h \geq m \|h\|^2.$$

Beweis

Wir wählen ϵ so klein, dass $R(h) \leq \frac{m}{2}||h||^2$ gilt für $||h|| < \epsilon$ (was geht wegen Taylorformel). Damit erhalten wir

$$f(a+h) \geq f(a) + m||h||^2.$$

und damit hat f ein lokales Minimum in a .

Der Fall $f''(a) < 0$ wird mit Betrachtung von $-f$ durch den vorigen Fall bewiesen.

Beweis

Es sei nun $f''(a) \geq 0$ und v mit $v^T f''(a)v > 0$ und w mit $w^T f''(a)w < 0$. Betrachten wir die Funktionen

$$F_v(t) := f(a + tv)$$

$$F_w(t) := f(a + tw)$$

dann ist

$$F'_v(t) = 0; \quad F''_v(0) = v^T f''(a)v > 0$$

$$F'_w(t) = 0; \quad F''_w(0) = w^T f''(a)w < 0$$

und somit hat F_v ein isoliertes lokales Maximum und F_w ein isoliertes lokales Minimum und damit f kein lokales Extremum in a .

Mittelwertsatz

Ist $f : U \rightarrow \mathbb{R}$ eine differenzierbare Funktion und $a, b \in U$ Punkte, deren Verbindungsstrecke in U verläuft. Dann gibt es einen Punkt ξ auf dieser Verbindungsstrecke mit

$$f(b) - f(a) = df(\xi)(b - a) = f'(\xi)(b - a)$$

Beweis Mittelwertsatz

Die Verbindungsstrecke ist gegeben durch $\gamma(t) := a + t(b - a)$ mit $t \in [0, 1]$. Für $F := f \circ \gamma : [0, 1] \rightarrow \mathbb{R}$ gilt $f(b) - f(a) = F(1) - F(0)$. Nach der Kettenregel ist F differenzierbar. Mit dem eindimensionalen Mittelwertsatz gibt es also ein $\tau \in (0, 1)$ mit $F(1) - F(0) = F'(\tau)$. Mit der Kettenregel folgt $F'(\tau) = df(\gamma(\tau))(b - a)$ und somit folgt mit $\xi = \gamma(\tau)$ die Behauptung.