Mehrdimensionale Differenzierbarkeit

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

$$pr_i : \mathbb{R}^k \to \mathbb{R}$$
$$pr_i(z) :=< e_i, z >_2 = z_i$$

die Projektionen auf die i-te Koordinate.

Mehrdimensionale Differenzierbarkeit

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

$$f \circ g : U \to W$$
$$(f \circ g)(x) := f(g(x))$$

die Hintereinanderausführung (Verkettung) von f und g.

Mehrdimensionale Differenzierbarkeit

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

$$F_i : U \subset \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$$
$$F_i(x) := (pr_i \circ F)(x) := pr_i(F(x))$$

differenzierbar sind.

Beweis

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

Kettenregel

Sind $g : U \subset \mathbb{R}^n \to V \subset \mathbb{R}^m$ und $f : V \subset \mathbb{R}^m \to W \subset \mathbb{R}^l$ 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

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

$$f(b+k) = f(b) + df(b)k + ||k||r_2(k); \quad \lim_{k\to 0} r_1(k) = 0$$

Beweis Kettenregel

Einsetzten ergibt

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

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

Beweis Kettenregel

Müssen nur noch zeigen, dass $\lim_{h\to 0} \frac{R(h)}{||h||} = 0$ 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 $f : U \to \mathbb{R}$ 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 $f : U \to \mathbb{R}$ für die alle partiellen Ableitungen

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

mit $i_1 + \cdots + i_k \leq k$ 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 $f : U \to \mathbb{R}$, $a \in U$ und Vektoren $v^1, \cdots, v^p \in \mathbb{R}^n$ heißt

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

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

$$d^p f(a)\big(v^1, \cdots, v^p\big) = \sum_{i_1=1}^{n} \cdots \sum_{i_p=1}^{n} \frac{\partial}{\partial x_{i_1}} \ldots \frac{\partial}{\partial x_{i_p}} f(a) \cdot v^1_{i_1} \cdots v^p_{i_p} \, .$$

Für einen Vektor $z \in \mathbb{R}^n$ definieren wir $d^p f(a) z^p := d^p f(a) \underbrace{(z, \cdots, z)}_{p-mal}$.

Hessematrix

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

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

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

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

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

Taylorapproximation

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

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

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

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

Mit obiger Abschätzung folgt die Behauptung.

Extrema

Sei $f : X \subset \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ eine relle 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.

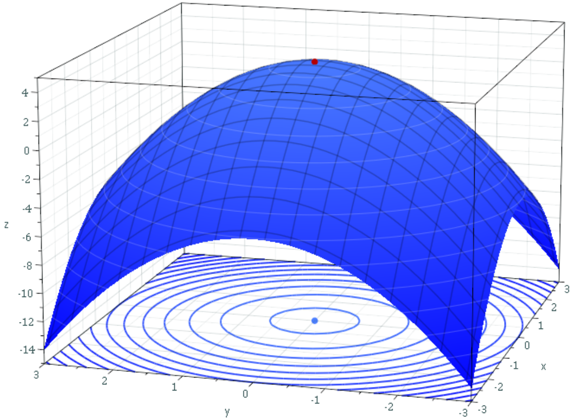

Figure: Quelle: Wikipedia: https://en.wikipedia.org/wiki/File:MaximumParaboloid.png

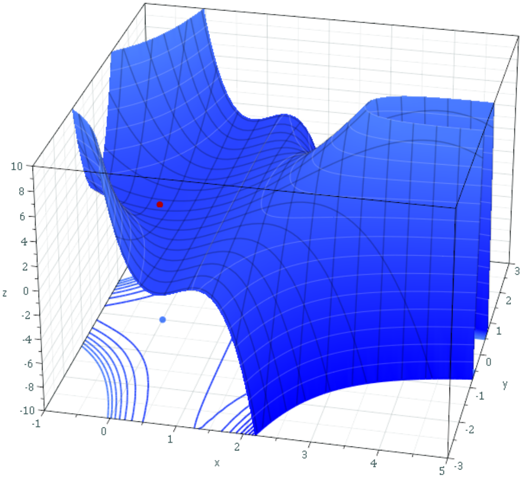

Figure: Quelle: Wikipedia:
https://en.wikipedia.org/wiki/File:MaximumCounterexample.png

Extrema

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

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

Dies ist 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 $F'(0) = 0$. Da $\frac{\partial}{\partial x_k} f(a) = F_k'(0)$ folgt die Behauptung.

Extrema

Ist $f : U \to \mathbb{R}$ 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.
- $f''(a) \gtrless 0 \Rightarrow f$ hat in a einen Sattelpunkt.

Extrema

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

Extrema

$f''(a) < 0 \Leftrightarrow x^t f''(a) x < 0 \;\; \forall x \in \mathbb{R}^n \Leftrightarrow$ 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 $\lim_{h \to 0} \frac{R(h)}{||h||} = 0$. 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 $f''(a) \gtrless 0$ 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

$$F_v'(t) = 0;\ F_v''(0) = v^T f''(a)v > 0$$
$$F_w'(t) = 0;\ F_w''(0) = w^T f''(a)w < 0$$

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