

第三讲、反函数和隐函数定理

基本内容： 隐函数求导、微分变换、压缩映射、反函数和隐函数定理

压缩映射定理 设 f 是 E 到 E 的映射, 其中 E 是完备度量空间, 且存在 $0 < \rho < 1$, 使得

$$|f(x) - f(y)| \leq \rho |x - y|, \quad \forall x, y \in E.$$

则存在惟一的 $x_0 \in E$, 使 $f(x_0) = x_0$.

映射的中值不等式 设凸区域 $D \subset \mathbb{R}^n$, f 在 D 上可微, $a, b \in D$, 则 $\exists \theta \in (0, 1)$, 使

$$|f(b) - f(a)| \leq \|J(a + \theta(b - a))\| \cdot |b - a|,$$

其中 $J(\cdot)$ 是 Jacobi 矩阵 $f'(\cdot) = \left(\frac{\partial f_i}{\partial x_j}(\cdot) \right)_{m \times n}$ 且 $\|J(\cdot)\| = \max_{1 \leq i \leq m, 1 \leq j \leq n} \left| \frac{\partial f_i}{\partial x_j}(\cdot) \right|$.

反函数存在定理 (局部逆映射存在定理) 设 $f: E \subset \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ 是 C^1 映射, $a \in E$, $b = f(a)$, 并且 Jacobi 矩阵 $f'(a)$ 可逆. 则

(1) 存在开集 $U \subset E$ 和 V , 使得 $a \in U$, $b \in V$, 并且 $f: U \rightarrow V$ 是 1-1 满映射;

(2) 设 $g = f^{-1}: V \rightarrow U$, 则 g 是 C^1 映射, 并且

$$g'(y) = (f'(g(y)))^{-1}, \quad y \in V.$$

隐函数存在定理 (局部隐映射存在定理) 设 $f: E \subset \mathbb{R}^{n+m} \rightarrow \mathbb{R}^m$ 是 C^1 映射, $(a, b) \in E$, $f(a, b) = 0$, 并且 Jacobi 矩阵 $f'_x(a, b)$ 可逆, 其中 “ $f'_x(a, b)$ ” 表示固定 y 而把 x 看成自变量而得到的 Jacobi 矩阵, 则

(1) 存在开集 $U \subset E$ 和 W , 使得 $(a, b) \in U$, $b \in W$, 且 $\forall y \in W$, 存在惟一的 x , 使得 $(x, y) \in U$, $f(x, y) = 0$;

(2) 设 $x = g(y)$, 则 g 是 C^1 映射, $g(b) = a$, $f(g(y), y) = 0, \quad \forall y \in W$, 并且

$$g'(y) = (f'_x(a, b))^{-1} \cdot f'_y(a, b).$$

隐函数组存在定理 (分量叙述形式) 考虑一个方程和三个变量的方程组

$$\begin{cases} F(x, y, u, v, w) = 0, \\ G(x, y, u, v, w) = 0, \\ H(x, y, u, v, w) = 0. \end{cases}$$

设

(1) $F(x, y, u, v, w)$, $G(x, y, u, v, w)$ 和 $H(x, y, u, v, w)$ 在点 $p_0(x_0, y_0, u_0, v_0, w_0)$ 的一个邻域内对各个变元有连续的偏导数;

(2) $F(x_0, y_0, u_0, v_0, w_0) = G(x_0, y_0, u_0, v_0, w_0) = H(x_0, y_0, u_0, v_0, w_0) = 0$;

(3) Jacobi 行列式 $J(p_0) = \frac{\partial(F, G, H)}{\partial(u, v, W)} \Big|_{p_0} = \begin{vmatrix} F_u(p_0) & F_v(p_0) & F_w(p_0) \\ G_u(p_0) & G_v(p_0) & G_w(p_0) \\ H_u(p_0) & H_v(p_0) & H_w(p_0) \end{vmatrix} \neq 0$. 则存在 p_0

点的一个邻域, 在此邻域内由方程组

$$\begin{cases} F(x, y, u, v, w) = 0, \\ G(x, y, u, v, w) = 0, \\ H(x, y, u, v, w) = 0 \end{cases}$$

可以惟一确定隐函数组

$$u = u(x, y), \quad v = v(x, y), \quad w = w(x, y),$$

使满足 $F(x, y, u(x, y), v(x, y), w(x, y)) = G(x, y, u(x, y), v(x, y), w(x, y)) = H(x, y, u(x, y), v(x, y), w(x, y)) = 0$ 及 $u_0 = u(x_0, y_0)$, $v_0 = v(x_0, y_0)$ 和 $w_0 = w(x_0, y_0)$, 且 u, v, w 具有关于 x, y 的连续偏导数, 满足

$$\begin{pmatrix} F_u & F_v & F_w \\ G_u & G_v & G_w \\ H_u & H_v & H_w \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} u_x & u_y \\ v_x & v_y \\ w_x & w_y \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} F_x & F_y \\ G_x & G_y \\ H_x & H_y \end{pmatrix}.$$

§3.1 隐函数求导(形式计算)

隐函数求导时, 涉及到一系列的复合的隐函数. 必须明辨函数关系, 弄清哪些是自变量, 哪些是因变量, 以免漏项.

例 1 设 $z = f(x, y)$ 是由方程 $F(x - y, y - z) = 0$ 确定的隐函数, 试求 z_x, z_y 及 z_{xy} .

例 2 设 $u(x, y)$ 是由方程组 $u = f(x, y, z, t), g(y, z, t) = 0, h(z, t) = 0$ 确定的函数, 其中 f, g, h 关于其各变量均连续可微, 且 $\frac{\partial(g, h)}{\partial(z, t)} \neq 0$, 求 $\frac{\partial u}{\partial y}$.

例 3 设 $u(x, y)$ 的所有二阶偏导数都连续, 且 $u(x, 2x) = x, u'_x(x, 2x) = x^2$ 以及 $u''_{xx} = u''_{yy}$. 求 $u''_{xx}(x, 2x), u''_{yy}(x, 2x)$ 和 $u''_{xy}(x, 2x)$.

例 4 设 $x = \cos \varphi \cos \psi, y = \cos \varphi \sin \psi, z = \sin \varphi$, 求 $\frac{\partial^2 z}{\partial x^2}$.

例 5 设 $u = f(x - ut, y - ut, z - ut), g(x, y, z) = 0$, 求 u_x, u_y . 这时 t 是自变量还是因变量?

§3.2 微分式变换

1. 仅变换自变量的情形.

例 1 在方程 $\left(\frac{\partial u}{\partial x}\right)^2 + \left(\frac{\partial u}{\partial y}\right)^2 = u$ 中作极坐标代换 $x = r \cos \theta, y = r \sin \theta$, 试求方程在变换后的形式.

例 2 通过代换 $x = uv, y = \frac{1}{2}(u^2 - v^2)$, 变换方程

$$\left(\frac{\partial z}{\partial x}\right)^2 + \left(\frac{\partial z}{\partial y}\right)^2 = \frac{1}{\sqrt{x^2 + y^2}}.$$

例 3 设方程

$$a \frac{\partial^2 z}{\partial x^2} + 2b \frac{\partial^2 z}{\partial x \partial y} + c \frac{\partial^2 z}{\partial y^2} = 0,$$

其中 a, b, c 都是常数, $b^2 - ac = 0, c \neq 0$, 作代换

$$u = x + \alpha y, \quad v = x + \beta y.$$

问如何选择 α, β , 能使代换后的方程有简单的形式?

2. 自变量与函数一起变换的情形(这种情况比只变自变量的情况稍复杂些, 它要多一个函数关系分析的步骤).

例 4 通过代换 $x = t, y = \frac{t}{1+tu}, z = \frac{t}{1+tv}$ 把方程 $x^2 z_x + y^2 z_y = z^2$ 变为以 v 为函数, t, u 为自变量的形式.

§3.3 压缩映射、反函数和隐函数定理

反函数存在定理的证明 (1) 设 $A = f'(a)$, 取 $\lambda > 0$, 使得 $2\lambda\|A^{-1}\| = 1$, 其中 $\|\cdot\|$ 表示矩阵的模(如 $\|A\| = \max_{1 \leq i, j \leq n} |a_{i,j}|$). 因为 f' 在 a 连续, 故可取以 a 为中心的开球 U , 使得

$$\|f'(x) - A\| < \lambda, \quad x \in U. \quad (1)$$

对 $y \in \mathbb{R}^n$, 定义带参数 y 的映射

$$\varphi(x) = x + A^{-1}(y - f(x)), \quad x \in U. \quad (2)$$

则 $f(x) = y$ 当且仅当 x 是 φ 的不动点. 再记 $V = f(U)$, 下面证明由 (2) 定义的映射对每一个任意固定的 $y \in V$ 有惟一不动点 x , 即存在惟一的 x 满足 $f(x) = y$. 这就证明了 f 是 U 到 V 的 1-1 可逆映射.

为此, 先对 φ 作估计, 其 Jacobi 矩阵为

$$\varphi'(x) = I - A^{-1}f'(x) = A^{-1}(A - f'(x)).$$

由公式 (1) 及 Schwarz 不等式得 $\|\varphi'(x)\| < \frac{1}{2}$, $x \in U$. 再由映射的中值不等式得

$$|\varphi(x_1) - \varphi(x_2)| \leq \frac{1}{2}|x_1 - x_2|, \quad x_1, x_2 \in U. \quad (3)$$

因此 φ 是一个压缩映射. 这说明对每一个 $y \in V$, 最多存在一个 $x \in U$, 满足 $\varphi(x) = x$.

其次, 注意到 $\forall y_0 \in V$, 存在 $x_0 \in U$, 使 $f(x_0) = y_0$. 取 r 足够小, 使以 x_0 为中心 r 为半径的开球 B 的闭包 $\bar{B} \subset U$. 限制 y 满足 $|y - y_0| < \lambda r$, 此时对于 \bar{B} 中的点 x 有

$$\begin{aligned} |\varphi(x) - x_0| &\leq |\varphi(x) - \varphi(x_0)| + |\varphi(x_0) - x_0| \leq \frac{1}{2}|x - x_0| + |A^{-1}(y - y_0)| \\ &\leq \frac{r}{2} + \|A^{-1}\| \cdot \lambda r \leq r, \end{aligned}$$

因此 $\varphi(x) \in \bar{B}$, 从而 φ 是 \bar{B} 上的压缩映射. 故存在 $x \in \bar{B}$, 使 $\varphi(x) = x$. 也即只要 y 满足 $|y - y_0| < \lambda r$ 就存在 $x \in \bar{B}$ 使 $f(x) = y$, 即 $y \in f(\bar{B}) \subset f(U) = V$. 结合上面两条就证明了 $\forall y \in V$ 存在惟一 $x \in U$ 使 $f(x) = y$. 所以 f 是 U 到 $V = f(U)$ 的 1-1 可逆映射. 上述讨论也证明了以 y_0 为中心 λr 为半径的开球位于 V 中, 故 V 是开集.

(2) 因为 f 是 C^1 映射, 故 $\det f'(x)$ 是 x 的连续函数. $f'(a)$ 可逆, 即 $\det f'(a) \neq 0$, 故不妨认为在公式 (1) 中给出的邻域 U 内, 都有 $\det f'(x) \neq 0$. 即 $f'(x)$ 可逆. 记其逆为 T . 设 g 是 f 的逆, 即 $x = g(y)$. 取 $y \in V$, $y + k \in V$. 于是 $\exists h \in \mathbb{R}^n$, 使 $x \in U$, $x + h \in U$ 及 $y = f(x)$, $y + k = f(x + h)$. 用公式 (2) 估计有

$$\varphi(x + h) - \varphi(x) = h + A^{-1}(f(x) - f(x + h)) = h - A^{-1}k,$$

由公式 (3) 得 $|h - A^{-1}k| \leq \frac{1}{2}|h|$, 即 $|A^{-1}k| \geq \frac{1}{2}|h|$, 从而

$$|k| \geq \lambda|h|. \quad (4)$$

于是

$$g(y + k) - g(y) - Ty = h - Tk = -T(f(x + h) - f(x) - f'(x)h).$$

所以

$$\frac{|g(y + k) - g(y) - Ty|}{|k|} \leq \frac{\|T\| \cdot |f(x + h) - f(x) - f'(x)h|}{\lambda|h|},$$

且当 $|k| \rightarrow 0$, 由 (4) 也有 $|h| \rightarrow 0$, 上式右边的极限为 0. 这就证明了 g 是可微映射, 且 $g'(y) = T = (f'(g(y)))^{-1}$. 容易验证 $g'(y)$ 为连续的. \square

注 设 $f: E \subset \mathbb{R}^{n+m} \rightarrow \mathbb{R}^n$ 是 C^1 映射, $(a, b) \in E$, 使 $f(a, b) = 0$, 并且 Jacobi 矩阵 $f'_x(a, b)$ 可逆. 这时方程 $f(x, y) = 0$ 在 (a, b) 的邻域内存在惟一 C^1 隐映射 $x = g(y)$ 的隐函数存在定理可通过定义 $F(x, y) = (f(x, y), y)$ 而转化为 F 的反函数存在定理. 事实上可检验反函数存在定理的条件成立, 因此存在 (a, b) 的开邻域 U 和 $(0, b)$ 的开邻域 V , 使 F 是 U 到 V 的 1-1 映射. 再设 W 是满足 $(0, y) \in V$ 的一切 $y \in \mathbb{R}^m$ 组成的集合即可.

§3.4 若干应用的例子

例 1 设 $f(x, y)$ 存在二阶连续偏导数, 且 $f''_{xx}f''_{yy} - (f''_{xy})^2 \neq 0$, 证明变换

$$\begin{cases} u = f'_x(x, y), \\ v = f'_y(x, y), \\ w = -z + xf'_x(x, y) + yf'_y(x, y) \end{cases}$$

存在唯一的逆变换

$$\begin{cases} x = g'_u(u, v), \\ y = g'_v(u, v), \\ z = -w + ug'_u(u, v) + vg'_v(u, v) \end{cases}.$$

例 2 设 f 为 \mathbb{R}^2 上的连续可微函数, 已知 $f(x, y) = 0$ 为 8 字形的曲线. 问

$$f_x(x, y) = 0, \quad f_y(x, y) = 0$$

在 \mathbb{R}^2 中至少有几组解?

例 3 设函数 $f(x, y)$, $g(x, y)$ 是定义在平面开区域 G 内的两个函数, 在 G 内均有连续的一阶偏导数, 且在 G 内任意点处均有

$$\frac{\partial f}{\partial x} \frac{\partial g}{\partial y} - \frac{\partial f}{\partial y} \frac{\partial g}{\partial x} \neq 0.$$

又设有界闭区域 $D \subset G$. 试证在 D 中满足方程组

$$\begin{cases} f(x, y) = 0 \\ g(x, y) = 0 \end{cases}$$

的点至多有有限个.

第三讲练习题

1. 设二元函数 $u = F(x, y)$ 满足方程

$$x \frac{\partial u}{\partial x} + y \frac{\partial u}{\partial y} = 0,$$

证明: $F(x, y)$ 在极坐标系下只是 θ 的函数.

2. 设 $A = (a_{ij})_{n \times n}$ 是正交矩阵, $f(\mathbf{y})$ 是定义在 \mathbf{R}^n 上的二次可微函数, $F(\mathbf{x}) = f(A\mathbf{x})$.

证明:

$$(a) \sum_{i=1}^n \left(\frac{\partial f}{\partial y_i} \right)^2 = \sum_{i=1}^n \left(\frac{\partial F}{\partial x_i} \right)^2; \quad (b) \sum_{i=1}^n \frac{\partial^2 f}{\partial y_i^2} = \sum_{i=1}^n \frac{\partial^2 F}{\partial x_i^2}.$$

3. 设 $z = z(x, y)$ 二阶连续可微, 对微分方程

$$\frac{1}{(x+y)^2} \left(\frac{\partial^2 z}{\partial x^2} + 2 \frac{\partial^2 z}{\partial x \partial y} + \frac{\partial^2 z}{\partial y^2} \right) - \frac{1}{(x+y)^3} \left(\frac{\partial z}{\partial x} + \frac{\partial z}{\partial y} \right) = 0$$

作变量代换

$$u = xy, \quad v = x - y.$$

求变换后的方程.

4. 对方程组

$$\begin{cases} x^3 + y^3 + z^3 = 3xyz, \\ x + y + z = a \end{cases}$$

确定的隐函数组 $y = y(x), z = z(x)$, 求 $\frac{dy}{dx}, \frac{dz}{dx}, \frac{d^2y}{dx^2}$ 和 $\frac{d^2z}{dx^2}$.

5. 以 $\xi = x + y, \eta = x - y$ 为新自变量, 变换方程 $\frac{\partial z}{\partial x} = \frac{\partial z}{\partial y}$.

6. 设 $u = xe^z, v = ye^z, w = ze^z$. 以 w 为新的函数, u, v 为新的自变量, 变换方程 $\frac{\partial z}{\partial x} = \frac{\partial z}{\partial y}$.

7. 设 $f: \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$ 为连续可微函数. 证明存在连续的单射 $g: [0, 1] \rightarrow \mathbb{R}^2$ 使得 $f \circ g$ 为常值.