

## Лекция 2

### 1.4. Экстремумы неявных функций

**Теорема 4.1.** (Теорема о неявной функции — частный случай) Пусть функция  $F : U \rightarrow \mathbb{R}$ , определённая в окрестности  $U \subset \mathbb{R}^{n+1}$  точки  $(x^{(0)}, y^{(0)}) = (x_1^{(0)}, \dots, x_n^{(0)}, y^{(0)})$ , такова, что

1.  $F \in C^k(U)$ ,  $k \geq 1$ ;
2.  $F(x^{(0)}, y^{(0)}) = F(x_1^{(0)}, \dots, x_n^{(0)}, y^{(0)}) = 0$ ;
3.  $F'_y(x^{(0)}, y^{(0)}) = F'_y(x_1^{(0)}, \dots, x_n^{(0)}, y^{(0)}) \neq 0$ .

Тогда существуют  $(n+1)$ -мерный промежуток  $I = I_x^n \times I_y \subset U$ , где

$$I_x^n = \{x = (x_1, \dots, x_n) \in \mathbb{R}^n : |x_i - x_i^{(0)}| < \alpha_i\}, \quad I_y = \{y \in \mathbb{R} : |y - y^{(0)}| < \beta\},$$

и такая функция  $u \in C^{(k)}(I_x^n, I_y)$ , что для всякой точки  $(x, y) \in I_x^n \times I_y$

$$F(x_1, \dots, x_n, y) = 0 \iff y = u(x_1, \dots, x_n). \quad (4.1)$$

При этом

$$\frac{\partial u}{\partial x_i}(x) = -\frac{F'_{x_i}(x, u(x))}{F'_y(x, u(x))}, \quad i = 1, \dots, n. \quad (4.2)$$

Пример 1. Найти стационарные точки неявно заданной неявно функции  $y$  от переменной  $x$ :

$$F(x, y) = x^2 + xy + y^2 = 27.$$

Так как

$$F'_x = 2x + y, \quad F'_y = x + 2y,$$

то по формуле (4.2) получаем

$$\frac{dy}{dx} = -\frac{2x + y}{x + 2y}.$$

Подставляя  $y = -2x$  в равенство  $F(x, y) = 0$ , получаем две стационарные точки  $(-3, 6)$ ,  $(3, -6)$ .

Пример 2. Найти стационарные точки заданной неявно функции  $z$  от переменных  $x$  и  $y$ :

$$F(x, y, z) = x^2 + y^2 + z^2 - 2x + 2y - 4z - 10.$$

Так как

$$F'_x = 2x - 2, \quad F'_y = 2y + 2, \quad F'_z = 2z - 4,$$

то по формуле (4.2) получаем

$$\frac{\partial z}{\partial x} = -\frac{x-1}{z-2}, \quad \frac{\partial z}{\partial y} = -\frac{y+1}{z-2}.$$

Подставляя  $x = 1$ ,  $y = -1$  в равенство  $F(x, y, z) = 0$ , получаем две стационарные точки  $(1, -1, -2)$ ,  $(1, -1, 6)$ .

Предположим, что нам дана дифференцируемая функция  $(n+1)$ -го аргументов  $\Phi(x_1, \dots, x_n, u)$ , причём аргумент  $u$  сам является дифференцируемой функцией  $n$  аргументов  $x_1, \dots, x_n$ . Тогда функцию  $\Phi(x_1, \dots, x_n, u)$  можно рассматривать как сложную функцию  $n$  аргументов  $x_1, \dots, x_n$ . Частные производные этой функции по  $x_i$ ,

$i = 1, \dots, n$ , называются *полными частными производными* функции  $\Phi(x_1, \dots, x_n, u)$  по  $x_i$  и обозначаются  $D\Phi/Dx_i$ . По правилу дифференцирования сложной функции имеем

$$\frac{D\Phi}{Dx_i} = \frac{\partial\Phi}{\partial u} \frac{\partial u}{\partial x_i} + \frac{\partial\Phi}{\partial x_i}, \quad i = 1, \dots, n. \quad (4.3)$$

Найдём частные производные второго порядка функции  $u$ , заданной неявно уравнением  $F(x_1, \dots, x_n, u) = 0$ . Введём обозначения

$$F'_i = \frac{\partial F}{\partial x_i}, \quad i = 1, \dots, n.$$

Используя формулы (4.2), получим

$$\frac{\partial^2 u}{\partial x_q \partial x_p} = \frac{D}{Dx_q} \left( -\frac{F'_p}{F'_u} \right) = \frac{\partial}{\partial u} \left( -\frac{F'_p}{F'_u} \right) \frac{\partial u}{\partial x_q} + \frac{\partial}{\partial x_q} \left( -\frac{F'_p}{F'_u} \right).$$

Имеем

$$\frac{\partial}{\partial u} \left( -\frac{F'_p}{F'_u} \right) = \frac{F''_{pu}F'_u - F''_{uu}F'_p}{F'^2_u} \frac{F'_q}{F'_u}, \quad \frac{\partial}{\partial x_q} \left( -\frac{F'_p}{F'_u} \right) = \frac{-F''_{pq}F'_u + F''_{uq}F'_p}{F'^2_u}.$$

Следовательно,

$$\frac{\partial^2 u}{\partial x_q \partial x_p} = \frac{F''_{pu}F'_qF'_u - F''_{uu}F'_pF'_q - F''_{pq}F'^2_u + F''_{uq}F'_pF'_u}{F'^3_u}. \quad (4.4)$$

В случае  $F = F(x, u)$  имеем

$$\frac{d^2 u}{dx^2} = \frac{2F''_{ux}F'_uF'_x - F''_{uu}F'^2_x - F''_{xx}F'^2_u}{F'^3_u}. \quad (4.5)$$

Пример 1 (продолжение).

Исследуем стационарные точки  $(-3, 6)$ ,  $(3, -6)$  на экстремальность. Для этого найдём  $d^2y/dx^2$ . Так как

$$F''_{xx} = 2, \quad F''_{xy} = 1, \quad F''_{yy} = 2, \quad ,$$

то по формуле (4.5) получаем

$$\frac{d^2 y}{dx^2} = -\frac{2(x+2y)(2x+y) - 2(2x+y)^2 - 2(x+2y)^2}{(x+2y)^3} = -\frac{6(x^2 + xy + y^2)}{(x+2y)^3}.$$

Следовательно,

$$\left. \frac{d^2 y}{dx^2} \right|_{(-3,6)} = -\frac{2}{9}, \quad \left. \frac{d^2 y}{dx^2} \right|_{(3,-6)} = \frac{2}{9}.$$

Таким образом, точка  $(-3, 6)$  является точкой максимума, а точка  $(3, -6)$  — точкой минимума.

Пример 2 (продолжение).

Исследуем стационарные точки  $(1, -1, -2)$ ,  $(1, -1, 6)$  на экстремальность. Вычислим матрицу вторых частных производных в этих точках. Воспользуемся формулами (4.2) и (4.3). Имеем

$$\frac{\partial^2 z}{\partial x^2} = -\frac{D}{Dx} \frac{x-1}{z-2} = \frac{x-1}{(z-2)^2} \frac{\partial z}{\partial x} - \frac{1}{z-2} = -\frac{(x-1)^2}{(z-2)^3} - \frac{1}{z-2},$$

Следовательно, в точках  $(1, -1, -2)$  и  $(1, -1, 6)$  матрица вторых частных производных равна

соответственно. Таким образом, точка  $(1, -1, -2)$  является точкой минимума, а точка  $(1, -1, 6)$  — точкой максимума.

Рассмотрим систему уравнений

которую будем решать относительно  $y_1, \dots, y_m$ , т. е. искать систему функциональных связей

локально эквивалентную системе (5.1).

Для краткости будем писать  $x = (x_1, \dots, x_n)$ ,  $y = (y_1, \dots, y_m)$ ; левую часть системы (5.1) будем записывать как  $F(x, y)$ , систему (5.1) как  $F(x, y) = 0$ , а отображение (5.2) как  $y = f(x)$ . Обозначим  $x^{(0)} = (x_1^{(0)}, \dots, x_n^{(0)})$ ,  $y^{(0)} = (y_1^{(0)}, \dots, y_m^{(0)})$ .

Далее положим

3

Заметим, что матрица  $F'_y(x, y)$  квадратная и, следовательно, она обратима тогда и только тогда, когда её определитель отличен от нуля. Матрицу, обратную к  $F'_y(x, y)$ , будем обозначать символом  $[F'_y(x, y)]^{-1}$ .

**Теорема 5.1.** (Теорема о неявной функции — общий случай) Пусть отображение  $F : U \rightarrow \mathbb{R}^m$ , определённое в окрестности  $U \subset \mathbb{R}^{n+m}$  точки  $(x^{(0)}, y^{(0)})$ , таково, что

1.  $F \in C^k(U)$ ,  $k \geq 1$ ;
2.  $F(x^{(0)}, y^{(0)}) = 0$ ;
3.  $F'_y(x^{(0)}, y^{(0)})$  — обратимая матрица.

Тогда найдутся такие окрестности  $U_x \subset \mathbb{R}^n$ ,  $U_y \subset \mathbb{R}^m$  точек  $x^{(0)}$ ,  $y^{(0)}$  и такое отображение  $f \in C^{(k)}(U_x, U_y)$ , что для всякой точки  $(x, y) \in U_x \times U_y$

$$F(x, y) = 0 \iff y = f(x). \quad (5.3)$$

При этом

$$f'(x) = -[F'_y(x, f(x))]^{-1}[F'_x(x, f(x))]. \quad (5.4)$$

Пусть на открытом множестве  $G \subset \mathbb{R}^n$  заданы непрерывно дифференцируемые функции

$$u_i = \varphi_i(x), \quad i = 1, \dots, m, \quad x \in G. \quad (5.5)$$

Если существуют открытое множество  $D$  в пространстве  $\mathbb{R}^{m-1}$  и непрерывно дифференцируемая на  $D$  функция  $\Phi(y_1, \dots, y_{m-1})$  такие, что в любой точке  $x \in G$  выполняется равенство

$$u_k(x) = \Phi(\varphi_1(x), \dots, \varphi_{k-1}(x), \varphi_{k+1}(x), \dots, \varphi_m(x)), \quad (5.6)$$

то функция  $u_k$  называется *зависимой на множестве  $G$*  от остальных функций (5.5).

Если среди функций системы (5.5) есть функция, зависящая от остальных на множестве  $G$ , то эта система называется *зависимой на множестве  $G$* . Если ни одна функция системы (5.5) не зависит от остальных на множестве  $G$ , то эта система называется *независимой на множестве  $G$* .

В вопросе зависимости системы функций (5.5) фундаментальную роль играет матрица Якоби этой системы

$$\left( \frac{\partial u_i}{\partial x_j} \right), \quad i = 1, \dots, m, \quad j = 1, \dots, n, \quad (5.7)$$

где  $i$  — номер строки,  $j$  — номер столбца.

**Теорема 5.2.** (Необходимое условие зависимости функций) Пусть  $m \leq n$  и система функций (5.5) зависима на открытом множестве  $G \subset \mathbb{R}^n$ . Тогда в любой точке этого множества ранг матрицы Якоби (5.7) этой системы меньше  $m$ .

**Следствие 1.** Пусть  $m = n$  и система функций (5.5) зависима на открытом множестве  $G \subset \mathbb{R}^n$ . Тогда её якобиан  $\frac{\partial(u_1, \dots, u_n)}{\partial(x_1, \dots, x_n)}$  равен нулю во всех точках множества  $G$ .

**Следствие 2.** (Достаточные условия независимости функций) Пусть  $m \leq n$  и пусть ранг матрицы Якоби (5.7) хотя бы в одной точке открытого множества  $G$  равен  $m$ . Тогда система (5.5) независима на множестве  $G$ .

**Теорема 5.3.** (Достаточные условия зависимости функций) Пусть ранг матрицы Якоби (5.7) системы функций (5.5) в каждой точке открытого множества  $G$  не превышает числа  $r$ ,  $r < m \leq n$ , а в некоторой точке  $x^{(0)} \in G$  равен  $r$ , иначе говоря, существуют такие переменные  $x_{j_1}, \dots, x_{j_r}$  и функции  $u_{i_1} = \Phi_{i_1}(x), \dots, u_{i_r} = \Phi_{i_r}(x)$ , что

$$\frac{\partial(u_{i_1}, \dots, u_{i_r})}{\partial(x_{j_1}, \dots, x_{j_r})} \quad (5.8)$$

Тогда все  $r$  функций, входящих в условие (5.8), независимы на множестве  $G$  и существует окрестность точки  $x^{(0)}$  такая, что любая из оставшихся  $m-r$  функций зависит на этой окрестности от указанных  $r$  функций.

## 1.6. Условный экстремум

Пусть на открытом множестве  $G \subset \mathbb{R}^n$  заданы функции

$$y_i = f_i(x), \quad i = 1, \dots, m, \quad x = (x_1, \dots, x_n) \in G. \quad (6.1)$$

Обозначим через  $E$  множество

$$E = \{x \in G : f_i(x) = 0, \quad i = 1, \dots, m\}. \quad (6.2)$$

Уравнения

$$f_i(x) = 0, \quad i = 1, \dots, m, \quad (6.3)$$

называются *уравнениями связи*.

Пусть на  $G \subset \mathbb{R}^n$  задана функция  $y = f_0(x)$ . Точка  $x^{(0)} \in E$  называется *точкой условного экстремума* функции  $f_0(x)$  относительно (или при выполнении) уравнений связи (6.3), если она является точкой обычного экстремума этой функции, рассматриваемой только на множестве  $E$ .

В дальнейшем будем предполагать, что:

1) все функции  $f_0, f_1, \dots, f_m$  непрерывно дифференцируемы на открытом множестве  $G$ ;

2) в рассматриваемой точке  $x^{(0)}$  векторы  $\nabla f_1, \dots, \nabla f_m$  линейно независимы, т. е. ранг матрицы Якоби

$$\left( \frac{\partial f_i}{\partial x_j} \right), \quad i = 1, \dots, m, \quad j = 1, \dots, n,$$

равен  $m$  — числу её строк (строки матрицы Якоби являются компонентами градиентов  $\nabla f_1, \dots, \nabla f_m$ ).

Согласно результатам предыдущего параграфа, это означает, что функции системы (6.1) независимы в некоторой окрестности точки  $x^{(0)}$ . Поскольку ранг матрицы не может быть больше числа столбцов, то из условия 2) следует, что  $m \leq n$ . Ввиду тривиальности случая  $m = n$ , будем считать, что  $m < n$ .

Согласно условию 2) в точке  $x^{(0)}$  хотя бы один из определителей вида

$$\frac{\partial(f_1, \dots, f_m)}{\partial(x_{j_1}, \dots, x_{j_m})}$$

отличен от нуля. Пусть для определённости в точке  $x^{(0)}$

$$\frac{\partial(f_1, \dots, f_m)}{\partial(x_1, \dots, x_m)} \neq 0. \quad (6.4)$$



где  $\lambda = (\lambda_1, \dots, \lambda_m)$ . Функция (7.1) называется *функцией Лагранжа*.

**2.** Находим стационарные точки функции  $\mathcal{L}(x, \lambda)$ . Для этого решаем систему  $(n + m)$  - уравнений с  $n + m$  неизвестными.

$$\begin{cases} \frac{\partial \mathcal{L}}{\partial x_i} = 0, & i = 1, \dots, n, \\ \frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \lambda_j} = f_j(x) = 0, & j = 1, \dots, m, \end{cases} \quad (7.2)$$

**3.** Рассмотрим стационарную точку. Выясним является ли она точкой экстремума. Для этого запишем второй дифференциал функции Лагранжа в этой точке.  $\mathcal{L}(x, \lambda)$

$$d^2\mathcal{L} = \sum_{i=1}^n \sum_{k=1}^n \frac{\partial^2 \mathcal{L}}{\partial x_i \partial x_k} dx_i dx_k \quad (7.3)$$

4. Дифференциалы  $dx_1, \dots, dx_n$  не являются независимыми. Условия связи (6.3) налагают на них условия

[illegible]

По условию ранг системы (7.4) равен  $m$ ,  $m < n$ . Следовательно, найдутся  $n - m$  независимых дифференциалов, через которые линейно выражаются остальные  $m$  дифференциалов. Для простоты будем считать независимыми  $dx_1, \dots, dx_{n-m}$ . Таким образом,

$$dx_i = \sum_{k=1}^{n-m} a_{ik} dx_k, \quad i = n-m+1, \dots, n. \quad (7.5)$$

Подставляя в (7.5) в (7.3), получим

$$d^2\mathcal{L} = \sum_{i=1}^{n-m} \sum_{k=1}^{n-m} A_{ik} dx_i dx_k \quad (7.6)$$

**5.** Исследуем получившуюся квадратичную форму на знакоопределённость, например с помощью критерия Сильвестра. Если  $d^2\mathcal{L} < 0$  ( $d^2\mathcal{L} > 0$ ), то рассматриваемая стационарная точка является точкой строгого условного максимума (строгого условного минимума); если же  $d^2\mathcal{L}$  неопределена, то данная точка не является точкой условного экстремума.

**Пример .** Найти условный экстремум функции

$$f(x, y, z) = xyz$$

при условиях

$$\varphi_1(x, y, z) = x + y - z - 3 = 0, \quad \varphi_2(x, y, z) = x - y - z - 8 = 0$$

Решение. 1) Составим функцию Лагранжа

$$L(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2) = xyz + \lambda_1(x + y - z - 3) + \lambda_2(x - y - z - 8).$$

2) Найдём стационарные точки функции  $\mathcal{L}(x, \lambda)$ . Запишем систему уравнений для определения параметров  $\lambda_1, \lambda_2$  и координат стационарных точек.

$$\left. \begin{aligned} \frac{\partial L}{\partial x} &= yz + \lambda_1 + \lambda_2 = 0, \\ \frac{\partial L}{\partial y} &= xz + \lambda_1 - \lambda_2 = 0, \\ \frac{\partial L}{\partial z} &= xy - \lambda_1 - \lambda_2 = 0, \\ x + y - z - 3 &= 0, \\ x - y - z - 8 &= 0. \end{aligned} \right\}$$

Решая эту систему уравнений, получим единственную стационарную точку

$$x = \frac{11}{4}, \quad y = -\frac{5}{2}, \quad z = -\frac{11}{4}, \quad \lambda_1 = \frac{11}{32}, \quad \lambda_2 = -\frac{231}{32}.$$

3) Найдём частные производные 2-го порядка. Имеем

$$\frac{\partial^2 L}{\partial x^2} = 0, \quad \frac{\partial^2 L}{\partial y^2} = 0, \quad \frac{\partial^2 L}{\partial z^2} = 0, \quad \frac{\partial^2 L}{\partial x \partial y} = z, \quad \frac{\partial^2 L}{\partial x \partial z} = y, \quad \frac{\partial^2 L}{\partial y \partial z} = x.$$

Следовательно, второй дифференциал функции  $L(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2)$  равен

$$d^2 L = 2z \, dx \, dy + 2y \, dx \, dz + 2x \, dy \, dz.$$

4) Связи дадут соотношения

$$dx + dy - dz = 0, \quad dx - dy - dz = 0.$$

В качестве независимого дифференциала можно взять  $dx$ . Имеем  $dz = dx$ ,  $dy = 0$ . Поэтому второй дифференциал функции Лагранжа с учётом связей равен

$$d^2 L = 2y \, dx^2.$$

В стационарной точке  $y = -5/2$ . Таким образом  $d^2 L = -5 \, dx^2$ .

5) Очевидно, что квадратичная форма  $d^2 L = -5 \, dx^2$  отрицательно определена. Таким образом, точка  $(11/4, -5/2, -11/4)$  является точкой максимума;  $f_{max} = 605/32$ .