Fourier Analysis

枫聆

2021 年 1 月 27 日

目录

The Genesis of Fourier Analysis

motivation

我们来问一个非常基础的问题: 给定 $[0,\pi]$ 上的函数 $f(f(0)=f(\pi))$，我们能否找到系数 A_m，使得下面等式成立?

$$f(x)=\sum_{m=1}^{\infty}A_m\sin mx$$

刚遇到这个问题，你会发现有点莫名奇妙的意思. 可能会想为什么会问这个问题? 其实我现在也不知道... 等学的过程中发现了再告诉你. 回到正题，这个问题是后面学习 fourier analysis 的比较重要的东西. 我们两边同乘 $\sin nx$，然后再积分.

$$\begin{aligned}\int_0^{\pi}f(x)\sin nxdx&=\int_0^{\pi}\left(\sum_{m=1}^{\infty}A_m\sin mx\right)\sin nxdx\\&=\sum_{m=1}^{\infty}A_m\int_0^{\pi}\sin mx\sin nxdx=A_n\cdot\frac{\pi}{2}.\end{aligned}$$

这里用到了一个 fact 即

$$\int_0^{\pi}\sin mx\sin nxdx=\begin{cases}0 & \text{if } m\neq m\\ \frac{\pi}{2} & \text{if } m=n\end{cases}$$

这个 fact 左边可以写成:

$$\int_0^{\pi}\frac{\cos(mx-nx)-\cos(mx+nx)}{2}.$$

在这里 m,n 都非负，所以只需要考虑 $m=n$. $cos(mx+nx)$ 在 $[0,\pi]$ 上积分为 0. 因此

$$A_n=\frac{2}{\pi}\int_0^{\pi}\sin mx\sin nxdx.$$

A_n 表示 n^{th} Fourier sine coefficient of f. 如果 f 刚好是一个奇函数函数则我们可以把定义域从 $[0,\pi]$ 扩展到更一般地 $[-\pi,\pi]$ 上. 类似我们可能会想如果 $[-\pi,\pi]$ 上一个偶函数 g，它是否可以表示成 cos 无穷级数呢?

$$g(x)=\sum_{m=0}^{\infty}A'_m\cos mx.$$

更一般地，任意的函数 F 在 $[-\pi,\pi]$ 上都可以表示为一个奇函数和一个偶函数的和.

$$F(x)=\frac{F(x)-F(-x)}{2}+\frac{F(x)+F(x)}{2}.$$

让 $f(x) = \frac{F(x)-F(-x)}{2}$ 和 $g(x) = \frac{F(x)+F(x)}{2}$. 这时候我们可能会问 F 能否写成下面的形式.

$$F(x) = \sum_{m=1}^{\infty} A_m \sin mx + \sum_{m=0}^{\infty} A'_m \cos mx.$$

这里我们再使用欧拉公式简化一下.

$$F(x) = \sum_{m=-\infty}^{\infty} a_m e^{imx}.$$

注意这里的负号, 这是因为 $\sin x = \frac{e^{imx}-e^{-imx}}{2i}$ 和 $\cos x = \frac{e^{imx}+e^{-imx}}{2}$ 这两个东西在这. 类似地, 我可以用前面方法两边同时乘上一个 e^{-inx}, 再积分.

$$\int_{-\pi}^{\pi} F(x)e^{-inx}dx = \int_{-\pi}^{\pi} \left(\sum_{m=-\infty}^{\infty} a_m e^{imx} \right) e^{-inx}dx.$$

这里同样可以用一个 fact.

$$\frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} e^{imx}e^{-inx}dx = \begin{cases} 0 & \text{if } n \neq m \\ 1 & \text{if } n = m \end{cases}$$

因此我们可以得到 a_n.

$$a_n = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} F(x)e^{-inx}dx.$$

这个 a_n 就是所谓的第 n 个 F 的傅里叶系数. 所以我们的问题来了: 给定一个 $[-\pi, \pi]$ 上一个 reasonable function $F(x)$. 然后用上面方法构造一系列系数, 那么下面的等式是否成立呢?

$$F(x) = \sum_{-\infty}^{\infty} a_m e^{imx}$$

Joseph Fourier 是第一个相信 “任意” 的函数 F 都可以被表示成上述的级数. 也就是说他相信任意的函数都可以表示成 $\cos sinmx$ 和 $\cos nx$ 的线性组合 (有可能是无限个). 对此的第一个证明是 Dirichlet.

傅里叶级数的基本性质

欧拉公式

频繁的出现，总会忘记它的堆导，不如一开始就记录下来. 欧拉最早是通过 $e^x, \sin x, \cos x$ 的泰勒展开式观察出来的欧拉公式

$$
\begin{aligned}
e^x &= 1 + x + \frac{1}{2!}x^2 + \frac{1}{3!}x^3 + \cdots \\
sin(x) &= x - \frac{1}{3!}x^3 + \frac{1}{5!}x^5 + \cdots \\
cos(x) &= 1 - \frac{1}{2!}x^2 + \frac{1}{4!}x^4 + \cdots
\end{aligned}
$$

把 $x = i\theta$ 带入 e^x 的泰勒展开式.

$$
\begin{aligned}
e^{i\theta} &= 1 + i\theta + \frac{(i\theta)^2}{2!} + \frac{(i\theta)^3}{3!} + \frac{(i\theta)^4}{4!} + \frac{(i\theta)^5}{5!} + \frac{(i\theta)^6}{6!} + \frac{(i\theta)^7}{7!} + \frac{(i\theta)^8}{8!} + \cdots \\
&= 1 + i\theta - \frac{\theta^2}{2!} - \frac{i\theta^3}{3!} + \frac{\theta^4}{4!} + \frac{i\theta^5}{5!} - \frac{\theta^6}{6!} - \frac{i\theta^7}{7!} + \frac{\theta^8}{8!} + \cdots \\
&= \left(1 - \frac{\theta^2}{2!} + \frac{\theta^4}{4!} - \frac{\theta^6}{6!} + \frac{\theta^8}{8!} - \cdots\right) + i\left(\theta - \frac{\theta^3}{3!} + \frac{\theta^5}{5!} - \frac{\theta^7}{7!} + \cdots\right) \\
&= \cos\theta + i\sin\theta
\end{aligned} \tag{1}
$$

简单而优雅，$e^{i\theta}$ 是一个圆周运动.

黎曼可积

Definition 3.1. 定义在 $[O, L]$ 上实数函数 f，如果满足 $f(x)$ 有界，且对任意的 $\varepsilon > 0$，存在一个 $[0, L]$ 上子划分 $0 = x_0 < x_1 < \cdots < x_{N-1} < x_N = L$，让 $\mathcal{U}$ 和 $\mathcal{L}$ 分别表示在这个子划分上的 upper and lower sums of f.

$$
\mathcal{U} = \sum_{j=1}^{N} \left[\sup_{x_{j-1} \le x \le x_j} f(x)\right](x_j - x_{j-1}).
$$

and

$$
\mathcal{L} = \sum_{j=1}^{N} \left[\inf_{x_{j-1} \le x \le x_j} f(x)\right](x_j - x_{j-1}).
$$

使得 $\mathcal{U} - \mathbb{L} < \varepsilon$.，则称这个函数 f 黎曼可积 (Riemann integrable).

直觉上只要如果 f 黎曼可积，只要划分的足够细，总能满足上述条件.

Example 3.2. 定义在 $[0,1]$ 上函数.

$$f(x)=\begin{cases}1 & \dfrac{1}{n+1}<x\leq\dfrac{1}{n},\ n \text{ is odd},\\ 0 & \dfrac{1}{n+1}<x\leq\dfrac{1}{n},\ n \text{ is even},\\ 0 & x=0.\end{cases} \tag{2}$$

虽然这个 f 在 $x=\frac{1}{n}$ 和 0 上并不是连续的，但是这个 f 是黎曼可积. 只要划分足够细，覆盖 $\frac{1}{n}$ 和 0 的子区间就足够小，对应的 upper sum 和 lower sum 的差值就越小.

Function on the circle

有一个周期为 2π 的周期函数和定义在单位元上的函数之间非常自然的关系式.

$$f(\theta)=F(e^{i\theta}).$$

单位圆上的点用 $e^{i\theta}$ 表示. where θ is a real number that is unique up to integer multiples of 2π(这句话我不明白 up to 是什么意思？可能是说 θ 和 $\theta+2k\pi$ 是等价呢？) 其中 F 是定义在单位元上的函数. 然后用每个 δ 作为定义域，构造一个函数 f，可以看出来 f 是 $\mathbb{R}$ 上周期为 2π 的周期函数. 因为 $f(\theta)=f(\theta+2\pi)$.

它们两者之间会都会保留比较好的性质，例如如果 f 在长度为 2π 区间上可积则 F 也同样在单位圆上可积. 连续，可微是也是相同.

主要的定义

开始正式的学习 fourier analysis，首先给出 fourier series 的准确定义.

Definition 3.3. 给定 f 在长度为 L 的区间 $[a,b](L=b-a)$ 上可积. 则 f 的第 n 项的 fourier coefficient 定义为

$$\hat{f}(n)=\frac{1}{L}\int_a^b f(x)e^{\frac{-2\pi inx}{L}}dx,\ n\in\mathbb{Z}.$$

f 的 fourier series 表示为

$$\sum_{n=-\infty}^{\infty}\hat{f}(n)e^{\frac{2\pi inx}{L}}.$$

为什么这里的 L 被放到了系数上?