

§0.1 第9章复习

一、连续

定义 设 f 在平面点集 D 有定义, $M_0(x_0, y_0) \in D$. 若对任意 $\varepsilon > 0$, 存在 $\delta > 0$, 使得当 $M(x, y) \in D$ 满足

$$\rho(M, M_0) < \delta, \text{ 或 } M \in D \cap B(M_0, \delta)$$

时, 有

$$|f(M) - f(M_0)| = |f(x, y) - f(x_0, y_0)| < \varepsilon,$$

则称 f 在 M_0 **连续**. 如果 f 是向量值函数, 只要将 $|f(M) - f(M_0)| < \varepsilon$ 换成 $\rho(f(M), f(M_0))$ 即可.

关键点: **邻域!** 在有度量的空间, 邻域可由距离给出. 例如值域中邻域是开区间, 由 $f(M)$ 到 $f(M_0)$ 的距离给出. (x_0, y_0) 的邻域由到该点距离不超过 δ 给出. 当然也可以用任意邻域 (如方形邻域) 代替.

说明: 对 D 中孤立点 $M_0(x_0, y_0)$ 当然也满足定义, 因此也可看成是连续点, 一般只考虑 $M_0 \in D$ 且是 D 的聚点.

二、复合函数的连续性

设 $z = f(u, v)$ 在 (u_0, v_0) 连续, $u = u(x, y), v = v(x, y)$ 在 (x_0, y_0) 连续, $u_0 = u(x_0, y_0), v_0 = v(x_0, y_0)$, 则 $z = f(u(x, y), v(x, y))$ 在 (x_0, y_0) 连续.

证明 $\forall \varepsilon > 0$, 根据 $z = f(u, v)$ 在 (u_0, v_0) 连续, 因此存在 $\delta' > 0$, 使得当 $|u - u_0| < \delta', |v - v_0| < \delta'$ 时有

$$|f(u, v) - f(u_0, v_0)| < \varepsilon$$

对于 $\delta' > 0$, 由 $u = u(x, y), v = v(x, y)$ 在 (x_0, y_0) 连续性知, $\exists \delta > 0$, 使得当 $|x - x_0| < \delta, |y - y_0| < \delta$ 时, 有

$$|f(u(x, y), v(x, y)) - f(u(x_0, y_0), v(x_0, y_0))| = |f(u, v) - f(u_0, v_0)| < \varepsilon.$$

其中 $u_0 = u(x_0, y_0), v_0 = v(x_0, y_0)$.

这里, 为了方便, 采用了方形邻域.

特例: 若 $f(x, y)$ 在 (x_0, y_0) 连续, $x = x(t), y = y(t)$ 在 t_0 连续, 且 $(x_0, y_0) = (x(t_0), y(t_0))$, 则 $f(x(t), y(t))$ 在 t_0 也连续. 如果把 $x = x(t), y = y(t)$ 看成是平面上一条路径 (曲线), 则连续函数沿任何连续路径也连续.

因此, $f(x, y)$ 连续, $\implies f(x, y_0)$ 和 $f(x_0, y)$ 分别对 y 和 x 连续.

但是: 即使沿任何路径连续, 也不能证明函数连续. 正是这个区别, 给我们判断不连续提供了方法.

判断不连续: 若 $x = x(t), y = y(t)$ 在 t_0 连续, 且 $(x_0, y_0) = (x(t_0), y(t_0))$, 但是 $f(x(t), y(t))$ 在 t_0 不连续, 那么 $f(x, y)$ 在 (x_0, y_0) 不连续. 这样判断 $f(x, y)$ 在 (x_0, y_0) 不连续, 只要找一条连续的通往 (x_0, y_0) 的路径, 沿该路径不连续即可. 例如判断 $f(x, y)$ 在 $(0, 0)$ 不连续只要考察沿 $x = 0$ 或 $y = 0$ 或 $y = kx, f(0, y)$ 或 $f(x, 0)$ 或 $f(x, kx)$ 不连续即可.

三、微分

单变量: $\Delta f = A\Delta x + o(\Delta x) \implies df = f'(x) dx$

多变量: $\Delta f = A\Delta x + B\Delta y + o(\rho)$

$$\begin{aligned} \implies df(x, y, z) &= \frac{\partial f}{\partial x} dx + \frac{\partial f}{\partial y} dy + \frac{\partial f}{\partial z} dz \\ &= \text{grad } f \cdot d\vec{r} = \nabla f \cdot d\vec{r}. \end{aligned}$$

这里

$$\text{grad } f = \frac{\partial f}{\partial x} \vec{i} + \frac{\partial f}{\partial y} \vec{j} + \frac{\partial f}{\partial z} \vec{k}; \quad d\vec{r} = dx \vec{i} + dy \vec{j} + dz \vec{k}$$

提供的基本信息:

单变量: 可微 \iff 可导, 切线的斜率以及切线方程.

单变量: 可微 \implies 偏导数存在, 切平面的法向量和切平面方程.

特别对于 $z = f(x, y)$, 可看成 $F(x, y, z) = z - f(x, y) = 0$, 因此法向量: $\text{grad } F = -f'_x \vec{i} - f'_y \vec{j} + \vec{k}$ 方向始终与 z 轴的正向夹角为锐角.

一阶微分形式不变性:

$$df(x, y, z) = \frac{\partial f}{\partial x} dx + \frac{\partial f}{\partial y} dy + \frac{\partial f}{\partial z} dz = \frac{\partial f}{\partial u} du + \frac{\partial f}{\partial v} dv + \frac{\partial f}{\partial w} dw$$

其中 $x = x(u, v, w)$, $y = y(u, v, w)$, $z = z(u, v, w)$ 因此

$$f(x, y, z) = f(x(u, v, w), y(u, v, w), z(u, v, w))$$

偏导数的链式法则:

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

$$\frac{\partial f}{\partial v} = \frac{\partial f}{\partial x} \frac{\partial x}{\partial v} + \frac{\partial f}{\partial y} \frac{\partial y}{\partial v} + \frac{\partial f}{\partial z} \frac{\partial z}{\partial v},$$

$$\frac{\partial f}{\partial w} = \frac{\partial f}{\partial x} \frac{\partial x}{\partial w} + \frac{\partial f}{\partial y} \frac{\partial y}{\partial w} + \frac{\partial f}{\partial z} \frac{\partial z}{\partial w},$$

方向导数:

$$\frac{\partial f}{\partial \vec{e}} = \text{grad } f \cdot \vec{e} = \nabla f \cdot \vec{e}$$

四、隐函数（这里以三维为例）

$$F(x, y, z) = 0, \quad (\text{隐式曲面})$$

局部: 在曲面上一点 (x_0, y_0, z_0) 邻域内, 存在 $z = z(x, y)$. 导数:

$$z'_x = -\frac{F'_x}{F'_z}, \quad z'_y = -\frac{F'_y}{F'_z}. \quad F'_z \neq 0$$

几何: 方程 $F(x, y, z) = 0$ 可看成是等值面, 对一般的等值面 $F(x, y, z) - c = 0$, 设等值面的参数方程表示为

$$\vec{r}(u, v) = x(u, v)\vec{i} + y(u, v)\vec{j} + z(u, v)\vec{k} \quad (u, v) \in D,$$

$$\implies F(x(u, v), y(u, v), z(u, v)) - c = 0$$

分别对 u, v 求导得

$$F'_x x'_u + F'_y y'_u + F'_z z'_u = 0, \quad \nabla F \cdot \vec{r}'_u = 0,$$

$$F'_x x'_v + F'_y y'_v + F'_z z'_v = 0, \quad \nabla F \cdot \vec{r}'_v = 0.$$

因此 ∇F 分别与 \vec{r}'_u 和 \vec{r}'_v 垂直, 即与 $\vec{r}'_u \times \vec{r}'_v$ 平行, 所以 ∇F 是等值面 $F(x, y, z) - c = 0$ 的法向量.

其他形式隐函数: 略.

五、极值

补充说明以下两个问题

最值问题 极值只考虑区域内部一点的邻域范围内. **最值要比较所有极值以及函数在边界上的极值问题.**

设 $f(x, y)$ 定义在有界闭区域 D 上, ∂D 是一条光滑闭曲线 $x = x(t), y = y(t), t \in [\alpha, \beta]$. 求 $f(x, y)$ 在 D 上的最大值、最小值.

首先通过 $f'_x(x, y) = f'_y(x, y) = 0$ 求出 D 内所有极值点和极值.

同时考虑 $f|_{\partial D} = f(x(t), y(t)) = \varphi(t)$ 在 $[\alpha, \beta]$ 上的最值 (单变量内部极值, 并与边界值 $\varphi(\alpha) = \varphi(\beta)$ 比较).

综合上述两部分比较内部极值和边界最值, 得到 f 在 D 上的最值.

对三元情形, 设 $u = f(x, y, z)$ 是定义在区域 V 上, V 是由曲面 S 围成, 如果 S 的参数方程表示为

$$x = x(u, v), y = y(u, v), z = z(u, v), (u, v) \in D$$

那么首先通过 $f'_x = f'_y = f'_z = 0$ 求出 $f(x, y, z)$ 在 V 内部的驻点并判断是否是极值点, 其次考虑 f 限制在 V 的边界 S 上的极值问题, 即考虑

$$\phi(u, v) = f(x(u, v), y(u, v), z(u, v)), (u, v) \in D$$

的极值问题, 通过 $\phi'_u = \phi'_v = 0$ 求出驻点, 再判断极值点, 最后与内部求出的极值点比较大小, 就可解决最值问题.

隐函数的极值问题 设 $y = y(x)$ 由方程 $F(x, y) = 0$ 给出, 通过

$$y' = -\frac{F'_x}{F'_y} = 0$$

求出驻点 $x_0, (y_0 = y(x_0))$. 若 $F'_y(x_0, y_0) = 0$, 那么隐函数不存在, 也就不存在

极值问题,因此只有当 $F'_y(x_0, y_0) \neq 0$, 讨论才可继续. 继续求导

$$y''(x_0) = -\frac{F''_{xx}F'_y - F'_x f''_{yy}}{(F'_y)^2} = -\frac{F''_{xx}}{F'_y}$$

判断驻点是否是极值点.

三维情况下: 设 $F(x, y, z) = 0$, 求隐函数 $z = z(x, y)$ 的极值. 代入方程 $F(x, y, z(x, y)) = 0$ 并分别对 x, y 求导, 得

$$z'_x(x, y) = -\frac{F_x(x, y, z)}{F'_z(x, y, z)}, \quad z'_y(x, y) = -\frac{F'_y(x, y, z)}{F'_z(x, y, z)}$$

因此驻点满足的方程为 $F'_x(x, y, z) = 0, F'_y(x, y, z) = 0, F(x, y, z) = 0$, 解出驻点后再作进一步判断.

六、向量值函数的微商和向量场的微商

向量值函数是 $\mathbb{R}^n \longrightarrow \mathbb{R}^m$ 中的映射, 需要掌握的是 $\mathbb{R} \longrightarrow \mathbb{R}^3$ 和 $\mathbb{R}^2 \longrightarrow \mathbb{R}^3$ 的情形, 在直角坐标系下, 两种情形分别是

$$\vec{r}: t \in [\alpha, \beta] \longrightarrow \vec{r}(t) = x(t)\vec{i} + y(t)\vec{j} + z(t)\vec{k}$$

$$\vec{r}: (u, v) \in D \longrightarrow \vec{r}(u, v) = x(u, v)\vec{i} + y(u, v)\vec{j} + z(u, v)\vec{k}.$$

因为直角坐标系的坐标向量 $\vec{i}, \vec{j}, \vec{k}$ 与变量无关, 因此对向量值函数的微商就是分别对分量的微商. 否则还要考虑对坐标向量的微商.

尤其注意微商运算与向量的点乘、叉乘运算之间的关系. 例如

$$\frac{d}{dt}(\vec{a} \cdot \vec{b}) = \frac{d\vec{a}}{dt} \cdot \vec{b} + \vec{a} \cdot \frac{d\vec{b}}{dt},$$

$$\frac{d}{dt}(\vec{r} \cdot \vec{r}) = \frac{d\vec{r}}{dt} \cdot \vec{r} + \vec{r} \cdot \frac{d\vec{r}}{dt} = 2\vec{r} \cdot \frac{d\vec{r}}{dt},$$

等等

向量场是 \mathbb{R}^3 中某个区域 V 内每一点 (x, y, z) 处都有一个向量, 记为

$$\vec{v} = P(x, y, z)\vec{i} + Q(x, y, z)\vec{j} + R(x, y, z)\vec{k}, \quad (x, y, z) \in V$$

因此关于 \vec{v} 的微商就是对每个分量的微商. 也可以把向量场理解为 $(x, y, z) \in \mathbb{R}^3 \longrightarrow \mathbb{R}^3$ 的映射, 因此求导规则与向量值函数一样.

七、例题

例 1 设 $u = f(x, y, z)$ 在 \mathbb{R}^3 上是 z 的连续函数, 且 $\frac{\partial f}{\partial x}, \frac{\partial f}{\partial y}$ 在 \mathbb{R}^3 上连续. 证明 u 在 \mathbb{R}^3 上连续.

证明 设增量 $h = \Delta x, k = \Delta y, l = \Delta z$

$$\begin{aligned} f(x+h, y+k, z+l) - f(x, y, z) &= f(x+h, y+k, z+l) - f(x, y, z+l) \\ &\quad + f(x, y, z+l) - f(x, y, z) \end{aligned}$$

其中当 $h, k, l \rightarrow 0$ 时, 有

$$\begin{aligned} f(x+h, y+k, z+l) - f(x, y, z+l) &= hf'_x(x+\theta h, y+\theta k, z+l) \\ &\quad + kf'_y(x+\theta h, y+\theta k, z+l) \rightarrow 0 \\ f(x, y, z+l) - f(x, y, z) &\rightarrow 0 \end{aligned}$$

例 2 设 a_1, a_2, \dots, a_n 是非零常数. $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$ 在 \mathbb{R}^n 上可微. 求证: 存在 \mathbb{R} 上一元可微函数 $F(s)$ 使得 $f(x_1, x_2, \dots, x_n) = F(a_1x_1 + a_2x_2 + \dots + a_nx_n)$ 的充分必要条件是 $a_j \frac{\partial f}{\partial x_i} = a_i \frac{\partial f}{\partial x_j}, i, j = 1, 2, \dots, n$.

证明 关键是证明充分性. 作可逆变换

$$t_1 = a_1x_1 + a_2x_2 + \dots + a_nx_n,$$

$$t_2 = a_2x_2 + \dots + a_nx_n,$$

...

$$t_n = a_nx_n$$

$$\Rightarrow \frac{\partial f}{\partial x_k} = \sum_{i=1}^k \frac{\partial f}{\partial t_i} a_k = a_k \sum_{i=1}^k \frac{\partial f}{\partial t_i}, k = 1, \dots, n$$

$$\Rightarrow \frac{\partial f}{\partial t_i} = 0, i = 2, 3, \dots, n$$

即 $f(x_1, \dots, x_n)$ 只依赖 t_1 , 所以 $f(x_1, \dots, x_n)$ 可以表示为 t_1 的函数.

例 3 可微函数 $f(x, y, z)$ 满足 $f(tx, ty, tz) = t^k f(x, y, z) (t > 0)$

$$\iff x f'_x(x, y, z) + y f'_y(x, y, z) + z f'_z(x, y, z) = k f(x, y, z).$$

证明 (\implies) $f(tx, ty, tz) = t^k f(x, y, z)$ 两边对 t 求导, 再令 $t = 1$ 即可.

(\impliedby) 令 $F(t) = f(tx, ty, tz)$, 对 t 求导得

$$\begin{aligned} F'(t) &= x f'_1(tx, ty, tz) + y f'_2(tx, ty, tz) + z f'_3(tx, ty, tz) \\ &= \frac{1}{t} (tx f'_1(tx, ty, tz) + ty f'_2(tx, ty, tz) + tz f'_3(tx, ty, tz)) \\ &= \frac{k}{t} f(tx, ty, tz) = \frac{k}{t} F(t) \end{aligned}$$

解得 $F(t) = C t^k$, 令 $t = 1$ 定出常数 $C = F(1) = f(x, y, z)$ 即可得结果.

一般来说, 若必要性求导可证, 则充分性可用积分.

例 4 设 F 连续偏导, $w = w(x, y, z)$ 是方程

$$F(x - aw, y - bw, z - cw) = 1$$

所确定的隐函数, a, b, c 常数, 求 $a \frac{\partial w}{\partial x} + b \frac{\partial w}{\partial y} + c \frac{\partial w}{\partial z}$

解: 由条件, 已知隐函数存在, 分别对 x, y, z 求导得

$$F_1(1 - aw'_x) + F_2'(0 - bw'_x) + F_3'(0 - cw'_x) = F_1' - w'_x(aF_1' + bF_2' + cF_3') = 0,$$

$$\implies w'_x = \frac{F_1'}{aF_1' + bF_2' + cF_3'}$$

同理可得 w'_y, w'_z 因此

$$a \frac{\partial w}{\partial x} + b \frac{\partial w}{\partial y} + c \frac{\partial w}{\partial z} = \frac{aF_1' + bF_2' + cF_3'}{aF_1' + bF_2' + cF_3'} = 1$$

这里 F_1', F_2', F_3' 等表示对三个位置的变量求导.

另外, 对诸如 $f(x, x^2)$ 的求导为

$$\frac{d}{dx} f(x, x^2) = f'_1(x, x^2) + 2x f'_2(x, x^2).$$

例 5 设 $f(x, y)$ 在 \mathbb{R}^2 上可微, 且满足:

$$\lim_{\rho \rightarrow 0} \frac{f(x, y)}{\rho} = +\infty,$$

证明: 对任意的 $\vec{v} = (v_1, v_2)$, 存在一点 (x_0, y_0) 使得 $\nabla f(x_0, y_0) = \vec{v}$.

分析 即要证存在一点 (x_0, y_0) 使得 $f'_x(x_0, y_0) = v_1, f'_y(x_0, y_0) = v_2$.

即要证 $F'_x(x_0, y_0) = F'_y(x_0, y_0) = 0$, 这里 $F(x, y) = f(x, y) - v_1x - v_2y$.

即要证 $F(x, y) = f(x, y) - v_1x - v_2y$ 有驻点.

因为

$$\left| \frac{v_1x + v_2y}{\rho} \right| \leq |v_1| + |v_2| \text{ (有界)},$$
$$\implies \lim_{\rho \rightarrow \infty} \frac{F(x, y)}{\rho} = \lim_{\rho \rightarrow 0} \frac{f(x, y) - v_1x - v_2y}{\rho} = +\infty$$

所以 $F(x, y)$ 在充分大的圆内取到最小值, 记最小值点为 (x_0, y_0) , 所以

$$F'_x(x_0, y_0) = f'_x(x_0, y_0) - v_1 = 0, F'_y(x_0, y_0) = f'_y(x_0, y_0) - v_2 = 0.$$

单变量类似的题目： 设 $f(x)$ 在 \mathbb{R} 上可微, 且 $\lim_{|x| \rightarrow \infty} \frac{f(x)}{x} = +\infty$, 证明:
对任意的实数 a , 存在 x_0 , 使得 $f'(x_0) = a$ (证明类似).

几何上看, 这样的函数切线的斜率 (也就是导数) 可以取到任意值.

例 6 设 $f(x, y)$ 在有界闭区域 D 上连续, 并存在偏导数, 若

$$f'_x(x, y) + f'_y(x, y) = f(x, y), \quad f(x, y) \Big|_{\partial D} = 0$$

则 $f(x, y)$ 在 D 上恒等于零.

证明 (反证法) 若 $f(x, y) \neq 0$, 则在内部必然存在最大值或最小值, 不妨设取到最大值 $f(x_0, y_0) > 0$,

$$f'_x(x_0, y_0) = f'_y(x_0, y_0) = 0$$

$$\implies f(x_0, y_0) = f'_x(x_0, y_0) + f'_y(x_0, y_0) = 0$$

矛盾.

例7 （最小二乘法）给定平面上 n 个点 $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$, 求一条直线 $y = ax + b$, 使得偏差

$$\sum_{i=1}^n (ax_i + b - y_i)^2$$

最小. 这里 x_1, \dots, x_n 互不相等.

解 上述问题是求

$$f(a, b) = \sum_{i=1}^n (ax_i + b - y_i)^2$$

的极值问题. 由 $\frac{\partial f}{\partial a} = \frac{\partial f}{\partial b} = 0$ 得关于 a, b 的方程组

$$\sum_{i=1}^n (ax_i + b - y_i)x_i = 0$$

$$\sum_{i=1}^n (ax_i + b - y_i) = 0$$

$$\begin{aligned} \left(\sum_{i=1}^n x_i^2 \right) a + \left(\sum_{i=1}^n x_i \right) b &= \sum_{i=1}^n x_i y_i \\ \left(\sum_{i=1}^n x_i \right) a + nb &= \sum_{i=1}^n y_i \end{aligned}$$

因为 x_1, \dots, x_n 互不相等, 所以

$$\left(\sum_{i=1}^n x_i \right)^2 = \left(\sum_{i=1}^n 1 \cdot x_i \right)^2 < \sum_{i=1}^n 1^2 \sum_{i=1}^n x_i^2 = n \sum_{i=1}^n x_i^2$$

即上述非齐次线性方程组系数行列式不为零, 因此有唯一解. 又因为只要所有的点 (x_i, y_i) 不在一条直线上, 就有

$$\lim_{\sqrt{a^2+b^2} \rightarrow \infty} f(a, b) = +\infty$$

因此 $f(a, b)$ 取到最小值.

例 8 求由方程

$$F(x, y, z) = 2x^2 + y^2 + z^2 + 2xy - 2x - 2y - 4z + 4 = 0$$

确定的隐函数的极值问题.

解: 分别对 x, y 求导得

$$4x + 2z \frac{\partial z}{\partial x} + 2y - 2 - 4 \frac{\partial z}{\partial x} = 0$$

$$2y + 2z \frac{\partial z}{\partial y} + 2x - 2 - 4 \frac{\partial z}{\partial y} = 0$$

驻点满足

$$\frac{\partial z}{\partial x} = \frac{\partial z}{\partial y} = 0$$

所以

$$2x + y - 1 = 0, \quad y + x - 1 = 0$$

解得驻点为 $(0, 1)$, 因此在驻点处 $z = z(0, 1)$ 满足方程 $z^2 - 4z + 3 = 0$ 解得 $z_1 = 1, z_2 = 3$. 这样, 我们就得到 $Oxyz$ 空间中两个点 $P_1(0, 1, 1)$ 和 $P_2(0, 1, 3)$.

不难验证,在 P_1, P_2 处, $\frac{\partial F}{\partial z} \neq 0$, 所以隐函数在 P_1, P_2 邻域内存在.

在 P_1 继续求导得

$$4 + 2(z'_x)^2 + 2zz''_{xx} - 4z''_{xx} = 0$$

$$2z'_x z'_y + 2zz''_{xy} + 2 - 4z''_{xy} = 0$$

$$2 + 2(z'_y)^2 + 2zz''_{yy} - 4z''_{yy} = 0$$

把 $(0, 1, 1)$ 代入并注意到 $z'_x = z'_y = 0$ 得

$$A = z''_{xx} = 2, B = z''_{xy} = 1, C = z''_{yy} = 1, \Delta = AC - B^2 > 0$$

所以在 P_1 附近确定的隐函数 $z = z(x, y)$ 在 $(0, 1)$ 取极小值 $z = 1$.

同理在 P_2 附近确定的隐函数 $z = z(x, y)$ 在 $(0, 1)$ 处取到极大值 $z = 3$.