

## §0.1 第12章复习

### 一、Fourier 展开

**哪些函数可以展开?** 理论上是对周期函数, 实际问题中, 只考虑定义在有限区间 (例如  $[-\pi, \pi]$ ) 上的函数的展开. 因为我们一方面可以做周期延拓, 另一方面在实际计算Fourier系数时, 只需要利用在  $[-\pi, \pi]$  上的积分.

**如何展开?** 计算Fourier 系数

$$a_k = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \cos kx \, dx, \quad k = 0, 1, \dots,$$

$$b_k = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \sin kx \, dx, \quad k = 1, 2, \dots,$$

$$f(x) \sim \frac{a_0}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} (a_n \cos nx + b_n \sin nx),$$

计算上述系数, 只要求  $f(x)$  在  $[-\pi, \pi]$  上可积且绝对可积. 同时注意奇延拓、偶延拓、任意区间等特殊情况.

**展开式是否收敛? 收敛到何处?** Dirichlet 定理 (Dirichlet 收敛):

$$\frac{a_0}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} (a_n \cos nx + b_n \sin nx) = \begin{cases} f(x), & \text{连续点} \\ \frac{f(x+0) + f(x-0)}{2} & \text{不连续点} \\ \frac{f(-\pi) + f(\pi)}{2} & \text{左右端点} \end{cases}$$

**条件: 分段可微.** 在任何区间  $[a, b]$  上, 除有限个点  $x_1, \dots, x_n$  外有连续的导数, 在这有限个点  $x_1, \dots, x_n$  处有左右极限以及下列广义单侧导数 (仍沿用单侧导数的记号)

$$f'(x_{i-1} + 0) = \lim_{x \rightarrow x_{i-1}^+} \frac{f(x) - f(x_{i-1} + 0)}{x - x_{i-1}}, \quad i = 1, \dots, n,$$

$$f'(x_i - 0) = \lim_{x \rightarrow x_i^-} \frac{f(x) - f(x_i - 0)}{x - x_i}, \quad i = 1, \dots, n.$$

这里  $i = 1, 2, \dots, n$ .

## 为什么 Fourier 级数有这么好的性质? 三角函数系的正交性. 三角函数系

$$1, \cos x, \sin x, \cos 2x, \sin 2x, \cdots, \cos nx, \sin nx, \cdots$$

在内积

$$\langle f, g \rangle = \int_{-\pi}^{\pi} f(x)g(x) dx$$

意义下是正交的:

$$\frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} \cos mx \cos nx dx = \delta_{mn}, \quad m, n = 0, 1, 2, \cdots$$

$$\frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} \sin mx \sin nx dx = \delta_{mn}, \quad m, n = 1, 2, \cdots$$

$$\frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} \cos mx \sin nx dx = 0. \quad m = 0, 1, 2, \cdots, \quad n = 1, 2, \cdots$$

其中

$$\delta_{mn} = \begin{cases} 1, & m = n; \\ 0, & m \neq n. \end{cases}$$

## 二、平方平均收敛

**内积空间**  $(L^2[a, b], \langle \cdot, \cdot \rangle)$ , 其中  $L^2[a, b]$  是区间  $[a, b]$  上可积且平方可积函数全体,

$$\langle f, g \rangle = \int_{-\pi}^{\pi} f(x)g(x) dx$$

**正交**:  $\langle f, g \rangle = 0$ .

**距离**:  $\|f - g\| = \sqrt{\langle f - g, f - g \rangle} = \sqrt{\int_a^b [f(x) - g(x)]^2 dx}$ .

**平方平均收敛**: 对  $L^2[a, b]$  中一个给定的函数  $f$ , 如果存在  $L^2[a, b]$  中的一个函数列  $\{f_n, n = 1, 2, \dots, \}$  使得

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \|f_n - f\|^2 = \lim_{n \rightarrow \infty} \int_a^b (f_n(x) - f(x))^2 dx = 0,$$

那么称  $f_n(x)$  平方平均收敛于  $f(x)$ .

这里主要讨论  $(L^2[-\pi, \pi], \langle \cdot, \cdot \rangle)$  上平方平均收敛, 并不需要 Dirichlet 定理. 为了区别, 通常称满足 Dirichlet 定理收敛称为逐点收敛

**Bessel 不等式** 在  $(L^2[-\pi, \pi], \langle \cdot, \cdot \rangle)$  内, 三角函数系

$$\left\{ \frac{1}{\sqrt{2\pi}}, \frac{\cos mx}{\sqrt{\pi}}, \frac{\sin mx}{\sqrt{\pi}}, m = 1, 2, \dots \right\}$$

为**标准正交系**. 且 Fourier 级数的部分和

$$S_n(x) = \frac{a_0}{2} + \sum_{k=1}^n (a_k \cos kx + b_k \sin kx)$$

是所有与  $f$  距离最小的三角多项式. 即对任意三角多项式  $T_n$ , 有

$$\|f - S_n\|^2 \leq \|f - T_n\|^2$$

而且部分和  $S_n$  到  $f$  的距离具体为:

$$\Delta_n = \|f - S_n\|^2 = \int_{-\pi}^{\pi} f^2(x) dx - \pi \left[ \frac{a_0^2}{2} + \sum_{k=1}^n (a_k^2 + b_k^2) \right].$$

因为  $\Delta_n \geq 0$ , 所以对任何  $n$ , 就有

$$\frac{a_0^2}{2} + \sum_{k=1}^n (a_k^2 + b_k^2) \leq \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f^2(x) dx.$$

## 结论

$$\frac{a_0^2}{2} + \sum_{k=1}^{\infty} (a_k^2 + b_k^2) \leq \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f^2(x) dx.$$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \cos nx dx = 0$$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} b_n = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \sin nx dx = 0$$

进一步, 有:

**平方平均收敛 (不需要 Dirichlet 收敛)** 设  $f(x) \in L^2[-\pi, \pi]$ , 则  $f(x)$  的 Fourier 级数部分和  $S_n(x)$  构成的三角多项式列平方平均收敛于  $f(x)$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \|f - S_n\|^2 = \int_{-\pi}^{\pi} (f(x) - S_n(x))^2 dx = 0$$

上述结论等价于 Bessel 不等式中的等号成立, 即 Parseval 等式

$$\frac{a_0^2}{2} + \sum_{k=1}^{\infty} (a_k^2 + b_k^2) = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f^2(x) dx.$$

对于  $L^2[-\pi, \pi]$  中存在其它非标准正交函数系

$$\{\varphi_1(x), \varphi_2(x), \cdots, \varphi_n(x), \cdots\}$$

若 Parseval 等式成立就称其为完备的. 此时对**广义 Fourier 级数**

$$f(x) \sim \sum_{n=1}^{\infty} a_n \varphi_n(x), \quad a_n = \int_a^b f(x) \varphi_n(x) dx$$

其部分和平方平均收敛于  $f(x)$ .

Parseval 等式有一个非常有趣的推论: 对于  $f(x) \in L^2[-\pi, \pi]$ , 即使不知道  $f(x)$  的 Fourier 级数

$$f(x) \sim \frac{a_0}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} (a_n \cos nx + b_n \sin nx),$$

是否是Dirichlet 收敛, 但是在任意闭区间  $[a, b] \subset [-\pi, \pi]$  上  $f(x)$  的Fourier 级数逐项积分是收敛的, 而且就收敛到  $f(x)$  在  $[a, b]$  上的积分

$$\int_a^b f(x) dx = \int_a^b \frac{a_0}{2} dx + \sum_{n=1}^{\infty} \int_a^b (a_n \cos nx + b_n \sin nx) dx.$$

**提醒:** 利用Parseval 等式及有关推论, 可以得到一些数项级数的和.



### 三、Fourier 变换

以下均假设  $f(x)$  在  $(-\infty, +\infty)$  上连续, 在任何有限区间上分段可微, 并且绝对可积.

#### Fourier 变换

$$f(x) \longmapsto F(\lambda) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(\xi) e^{-i\lambda\xi} d\xi.$$

#### Fourier 逆变换 ( Dirichlet 定理 )

$$F(\lambda) \longmapsto f(x) = \frac{1}{2\pi} \int_{-\infty}^{+\infty} d\lambda F(\lambda) e^{i\lambda x}.$$

#### 卷积和卷积与 Fourier 变换

$$f * g(x) := \int_{-\infty}^{+\infty} f(x-t) g(t) dt$$

$$F[f * g] = F[f] F[g].$$

## 四、例题

一、求  $f(x) = e^{ux}$  在  $[-1, 1]$  的 Fourier 展开。

解 利用任意区间上 Fourier 系数的计算公式, 有

$$a_0 = \int_{-1}^1 e^{ux} dx = \frac{2}{u} \sinh u,$$

$$a_n = \int_{-1}^1 e^{ux} \cos n\pi x dx = -\frac{u}{n\pi} \int_{-1}^1 e^{ux} \sin n\pi x dx = -\frac{u}{n\pi} b_n$$

$$b_n = \int_{-1}^1 e^{ux} \sin n\pi x dx = \frac{2(-1)^{n+1}}{n\pi} \sinh u + \frac{u}{n\pi} a_n.$$

$$\Rightarrow \begin{cases} a_n = \frac{(-1)^n 2u \sinh u}{u^2 + (n\pi)^2}, \\ b_n = \frac{(-1)^{n+1} 2n\pi \sinh u}{u^2 + (n\pi)^2} \end{cases}$$

因为  $f(x)$  连续, 因此

$$\frac{1}{u} \sinh u + 2 \sinh u \sum_{n=1}^{\infty} \frac{(-1)^n u}{u^2 + (n\pi)^2} (\cos n\pi x - 2n\pi \sin n\pi x) = e^{ux}, \quad |x| < 1$$

特别, 在  $x = 1$  处

$$\begin{aligned} \frac{1}{u} \sinh u + 2 \sinh u \sum_{n=1}^{\infty} \frac{u}{u^2 + (n\pi)^2} &= \frac{f(1) + f(-1)}{2} = \cosh u \\ \Rightarrow \frac{1}{u} + \sum_{n=1}^{\infty} \frac{2u}{u^2 + (n\pi)^2} &= \frac{\cosh u}{\sinh u} \end{aligned}$$

## 二、求

$$f(x) = \begin{cases} -1, & -\pi \leq x < 0, \\ 1, & 0 \leq x \leq \pi \end{cases}$$

的Fourier级数, 并求级数  $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{\cos(2n-1)x}{(2n-1)^2}$ ,  $0 \leq x \leq \pi$  的和。

解  $f(x)$  是奇函数分段可微, 所以

$$a_n = 0, \quad b_n = \frac{2}{\pi} \int_0^{\pi} \sin nx \, dx = \frac{2(1 - (-1)^n)}{n\pi},$$

$f(x)$  的Fourier 级数收敛

$$\frac{4}{\pi} \sum_{n=1}^{\infty} \frac{\sin(2n-1)x}{2n-1} = \begin{cases} f(x), & |x| < \pi, x \neq 0 \\ 0, & x = 0, x = \pm\pi \end{cases}$$

首先由Parseval 等式得

$$\frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f^2(x) \, dx = \sum_{n=1}^{\infty} \frac{16}{\pi^2(2n-1)^2}, \Rightarrow \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{(2n-1)^2} = \frac{\pi^2}{8}$$

再对展开式在  $[0, x]$  上积分

$$\int_0^x 1 \, dt = \frac{4}{\pi} \sum_{n=1}^{\infty} \int_0^x \frac{\sin(2n-1)t}{2n-1} \, dt = \frac{4}{\pi} \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1 - \cos(2n-1)x}{(2n-1)^2}$$

因此

$$\sum_{n=1}^{\infty} \frac{\cos(2n-1)x}{(2n-1)^2} = \frac{\pi^2}{8} - \frac{\pi x}{4}$$

三、设  $f(x)$  在  $[-\pi, \pi]$  连续, 且  $f'(x) \in L^2[-\pi, \pi]$ , 如果  $f(x)$  满足

$$f(-\pi) = f(\pi), \quad \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \, dx = 0,$$

证明:

$$\int_{-\pi}^{\pi} |f'(x)|^2 \, dx \geq \int_{-\pi}^{\pi} f^2(x) \, dx,$$

等号成立当且仅当  $f(x) = a \cos x + b \sin x$ .

**证明** 将  $f(x)$  和  $f'(x)$  分别作Fourier展开, 由条件可知  $a_0 = 0$ ,  $a'_0 = 0$ , 所以

$$f(x) \sim \sum_{n=1}^{\infty} a_n \cos nx + b_n \sin nx,$$

$$f'(x) \sim \sum_{n=1}^{\infty} a'_n \cos nx + b'_n \sin nx,$$

不难计算  $a'_n = nb_n$ ,  $b'_n = -na_n$ , 利用 Parseval 等式得

$$\begin{aligned} \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} |f'(x)|^2 dx &= \sum_{n=1}^{\infty} (a_n'^2 + b_n'^2) = \sum_{n=1}^{\infty} n^2 (a_n^2 + b_n^2) \\ &\geq \sum_{n=1}^{\infty} (a_n^2 + b_n^2) = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f^2(x) dx, \end{aligned}$$

显然, 等号成立当且仅当  $a_n = b_n = 0, n \geq 2$ , 所以

$$f(x) \sim a_1 \cos x + b_1 \sin x.$$

当  $a_n = b_n = 0, n \geq 2$  时, 连续函数  $f(x) - (a_1 \cos x + b_1 \sin x)$  与三角函数系中每一个都正交, 所以等号成立当且仅当

$$f(x) = a_1 \cos x + b_1 \sin x.$$

**四、等周问题 (Hurwitz)** 在给定长度为  $L$  的一切平面曲线中, 什么样的曲线围成的面积最大? 或: 设  $\ell$  是平面上长度为  $L$  的简单光滑闭曲线,  $S$  是  $\ell$  围成平面区域的面积, 证明:

$$S \leq \frac{L^2}{4\pi}$$

并问等号成立时, 曲线的具体形状.

**证明** 从曲线  $\ell$  上某点开始逆时针计算弧长  $s$  并作为参数, 因此

$$x = x(s), \quad y = y(s) \quad (0 \leq s \leq L),$$

$$x(0) = x(L), \quad y(0) = y(L).$$

根据弧长参数曲线的性质, 有

$$ds^2 = dx^2 + dy^2, \quad \text{或} \quad \left(\frac{dx}{ds}\right)^2 + \left(\frac{dy}{ds}\right)^2 = (x'(s))^2 + (y'(s))^2 = 1.$$



做变换  $t = \frac{2\pi s}{L} - \pi$ , 使  $\ell$  的参数方程表示为如下形式

$$x = x(s) = \varphi(t), \quad y = y(s) = \psi(t), \quad (-\pi \leq t \leq \pi),$$

$$\varphi(-\pi) = \varphi(\pi), \quad \psi(-\pi) = \psi(\pi),$$

并且参数  $t$  增加的方向是曲线的逆时针方向. 因为

$$\begin{aligned} \frac{dx}{ds} &= \frac{d\varphi(t)}{dt} \frac{dt}{ds}, \quad \frac{dy}{ds} = \frac{d\psi(t)}{dt} \frac{dt}{ds}, \quad \frac{dt}{ds} = \frac{2\pi}{L} \\ &\implies (\varphi'(t))^2 + (\psi'(t))^2 = \frac{L^2}{4\pi^2}. \end{aligned}$$

分别对  $\varphi(t)$ ,  $\psi(t)$  作Fourier 展开

$$\begin{aligned} \varphi(t) &= \frac{a_0}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} a_n \cos nt + b_n \sin nt, \\ \psi(t) &= \frac{c_0}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} c_n \cos nt + d_n \sin nt. \end{aligned}$$

不难算出,  $\varphi'(t)$ ,  $\psi'(t)$  的 Fourier 展开为

$$\varphi'(t) \sim \sum_{n=1}^{\infty} n b_n \cos nt - n a_n \sin nt,$$

$$\psi'(t) \sim \sum_{n=1}^{\infty} n d_n \cos nt - n c_n \sin nt.$$

这是因为

$$\frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} \varphi'(t) \cos nt \, dt = \frac{1}{\pi} \varphi(t) \cos nt \Big|_{-\pi}^{\pi} + \frac{n}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} \varphi(t) \sin nt \, dt = n b_n$$

其他系数的计算类似. 根据 Parseval 等式, 有

$$\frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} (\varphi'(t))^2 \, dt = \sum_{n=1}^{\infty} n^2 (a_n^2 + b_n^2),$$

$$\frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} (\psi'(t))^2 \, dt = \sum_{n=1}^{\infty} n^2 (c_n^2 + d_n^2).$$

$$\Rightarrow \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} ((\varphi'(t))^2 + (\psi'(t))^2) \, dt = \sum_{n=1}^{\infty} n^2 (a_n^2 + b_n^2 + c_n^2 + d_n^2),$$

另一方面

$$\frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} ((\varphi'(t))^2 + (\psi'(t))^2) dt = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} \frac{L^2}{4\pi^2} dt = \frac{L^2}{2\pi^2},$$

$$\implies L^2 = 2\pi^2 \sum_{n=1}^{\infty} n^2 (a_n^2 + b_n^2 + c_n^2 + d_n^2).$$

下面计算曲线  $\ell$  围成的面积, 根据 Green 定理的推论, 该面积为

$$S = \oint_{\ell} x dy = \int_{-\pi}^{\pi} \varphi(t) \psi'(t) dt = \pi \sum_{n=1}^{\infty} n (a_n d_n - b_n c_n),$$

其中我们利用了 Parseval 等式的推论 (两个函数乘积的积分等于对应 Fourier 系

数乘积求和)。最终, 我们有

$$\begin{aligned} L^2 - 4\pi S &= 2\pi \left( \sum_{n=1}^{\infty} n^2(a_n^2 + b_n^2 + c_n^2 + d_n^2) - \sum_{n=1}^{\infty} 2n(a_nd_n - b_nc_n) \right) \\ &= 2\pi \left( \sum_{n=1}^{\infty} ((na_n - d_n)^2 + (nc_n + b_n)^2) + \sum_{n=1}^{\infty} (n^2 - 1)(b_n^2 + d_n^2) \right) \\ &\geq 0. \end{aligned}$$

所以

$$L^2 - 4\pi S \geq 0, \text{ 或 } S \leq \frac{L^2}{4\pi}.$$

等号成立当且仅当求和项中所有项均为零, 即

$$na_n = d_n, \quad nc_n = -b_n, \quad n \geq 1; \quad b_n = d_n = 0, \quad n \geq 2.$$



$$a_1 = d_1, \quad c_1 = -b_1, \quad a_n = b_n = c_n = d_n = 0 \quad n \geq 2.$$

这样的曲线为

$$\begin{aligned}x(t) &= \frac{a_0}{2} + a_1 \cos t + b_1 \sin t, \\y(t) &= \frac{c_0}{2} - b_1 \cos t + a_1 \sin t,\end{aligned}$$

这个曲线不是别的正是圆

$$\left(x - \frac{a_0}{2}\right)^2 + \left(y - \frac{c_0}{2}\right)^2 = a_1^2 + b_1^2.$$

五、设  $f$  是周期为  $2\pi$  且在  $[-\pi, \pi]$  上 Riemann 可积的函数. 如果它在  $(-\pi, \pi)$  上单调, 证明:

$$a_n = O\left(\frac{1}{n}\right), \quad b_n = O\left(\frac{1}{n}\right) \quad (n \rightarrow \infty).$$

**证明** 由于

$$a_n = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \cos nx \, dx = \frac{1}{n\pi} \int_{-n\pi}^{n\pi} f\left(\frac{x}{n}\right) \cos x \, dx,$$

所以只要证明

$$na_n = \frac{1}{\pi} \int_{-n\pi}^{n\pi} f\left(\frac{x}{n}\right) \cos x \, dx$$

有界即可. 不妨设  $f(x)$  单调减, 令

$$x_k = -n\pi + 2k\pi, \quad k = 0, \dots, n, \quad \Delta x_k = 2\pi.$$

$$\begin{aligned}
 \int_{-n\pi}^{n\pi} f\left(\frac{x}{n}\right) \cos x \, dx &= \sum_{k=0}^{n-1} \int_{x_k}^{x_{k+1}} f\left(\frac{x}{n}\right) \cos x \, dx \\
 &= \sum_{k=0}^{n-1} \int_{x_k}^{x_{k+1}} \left( f\left(\frac{x}{n}\right) - f\left(\frac{x_k}{n}\right) \right) \cos x \, dx \\
 &\quad + \sum_{k=0}^{n-1} f\left(\frac{x_k}{n}\right) \int_{x_k}^{x_{k+1}} \cos x \, dx
 \end{aligned}$$

其中

$$\int_{x_k}^{x_{k+1}} \cos x \, dx = 0$$

即上式第二项求和为零. 再利用函数单调减性质, 当  $x \in [x_k, x_{k+1}]$  时, 有

$$0 \leq f\left(\frac{x_k}{n}\right) - f\left(\frac{x}{n}\right) \leq f\left(\frac{x_k}{n}\right) - f\left(\frac{x_{k+1}}{n}\right)$$

所以

$$\begin{aligned}
 \left| \int_{-n\pi}^{n\pi} f\left(\frac{x}{n}\right) \cos x \, dx \right| &\leq \sum_{k=0}^{n-1} \int_{x_k}^{x_{k+1}} \left( f\left(\frac{x_k}{n}\right) - f\left(\frac{x}{n}\right) \right) |\cos x| \, dx \\
 &\leq \sum_{k=0}^{n-1} \int_{x_k}^{x_{k+1}} \left( f\left(\frac{x_k}{n}\right) - f\left(\frac{x_{k+1}}{n}\right) \right) \, dx \\
 &= \sum_{k=0}^{n-1} \left( f\left(\frac{x_k}{n}\right) - f\left(\frac{x_{k+1}}{n}\right) \right) 2\pi \\
 &= (f(-\pi) - f(\pi)) 2\pi
 \end{aligned}$$

这样我们就证明了积分

$$\int_{-n\pi}^{n\pi} f\left(\frac{x}{n}\right) \cos x \, dx$$

有界, 也就是  $na_n$  有界, 同理可证  $nb_n$  有界.