12. cvičení - LS 2017

Michal Outrata

Opakování z přednášky

- Funkce dvou proměnných obrázky;
- Funkce dvou proměnných na množině;
- Parciální derivace, Jaccobián;
- Množiny (hranice, vnitřek, kompaktní množina), implicitně zadané množiny a jejich vazby;
- Rovnice přímky (normálová), oaramterické zadání úsečky pomocí dvou bodů;
- Extrémy funkce na kompaktní množině
 - existence
- Krok 1 Rozdělíme množinu M na hranici a vnitřek;
- Krok 2 Určíme body B, pro které $\partial_x f(B) = \partial_y f(B) = \partial_z f(B) = 0$ a ke kandidátům na extrém přidáme všechny takové **ve vnitřku množiny** M;
- Krok 3 ROzdělíme hranici množiny na vrcholy (body, dimenze 0), hrany (úsečky nebo křivky, dimenze 1) a stěny (plochy, dimenze 2 pouze pokud f = f(x, y, z));
- Krok 4 Každá část hranice se musí v principu prověřit tedy provést nějaký úkon, který nám řekne, zda se na hranici nachází nějaký kandidát na extrém funkce;
- Krok 5 Dostaneme (snad) pouze několik kandidátů na extrémy. Porovnáním vybereme minimum a maximum funkce f na množině M.

Takže zbývá jen rozpracovat **Krok 4** - jinak vše umíme. My se naučíme používat tři metody:

- **Dosazovací metoda** nejlehčí z metod a zároveň nejvíce specifická. Máme-li hranici množiny zadanou implicitně rovnicí g(x,y) = 0, můžeme se pokusit vyjádřit z této rovnice jednu z proměnných, dosadit ji do předpisu funkce a hledat posléze extréme této nové funkce na příslušně upravené množině. Všechny takové extrémy přidáme do seznamu kandidátů na extrémy funkce f na množině M;
- **Metoda Jaccobiánu pro** f(x,y) metoda pro funkce dvou proměnných máme-li hranici množiny zadanou implicitně rovnicí g(x,y)=0, pak tato metoda je založená na řešení následující soustavy rovnic

$$\partial_x f(x,y) \cdot \partial_y g(x,y) - \partial_y f(x,y) \cdot \partial_x g(x,y) = 0$$

 $g(x,y) = 0$

Všechna řešení rovnice výše přidáme do seznamu kandidátů extrémů funkce f v množině M;

– **Metoda Jaccobiánu pro** f(x,y,z) - metoda pro funkce tří proměnných - máme-li hranici množiny zadanou implicitně rovnicemi $g_1(x,y,z)=0, g_2(x,y,z)=0$ pak tato metoda je založená na řešení následující speciální soustavy rovnic

$$\det(J_{f,g_1,g_2}(x, y, z) = 0$$

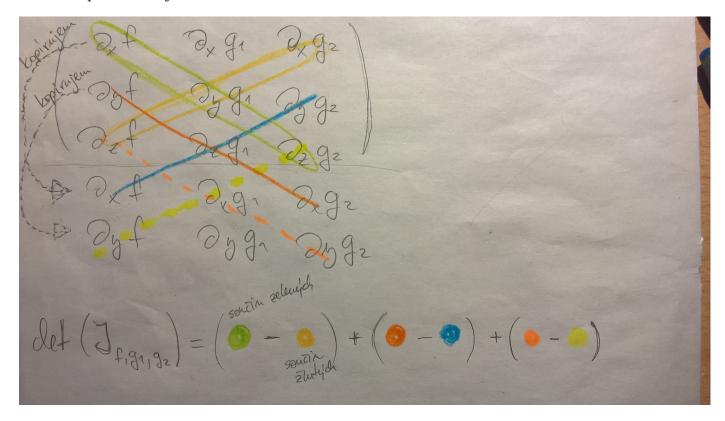
$$g_1(x, y, z) = 0$$

$$g_2(x, y, z) = 0.$$

Druhá a třetí rovnice jsou jasné, jednoduše se chceme udržet na hranici. První rovnici je zapotřebí vysvětlit - konkrétně souhrn písmenek $\det(J_{f,g_1,g_2}(x,y,z))$. Vztahuje se k součinu parciálních derivací funkcí f, g_1 a g_2 . Formálně je tento symbol definován jako

$$\det (J_{f,g_1,g_2}(x,y,z)) = (\partial_x f \cdot \partial_y g_1 \cdot \partial_z g_2 - \partial_z f \cdot \partial_y g_1 \cdot \partial_x g_2) + + (\partial_y f \cdot \partial_z g_1 \cdot \partial_x g_2 - \partial_y g_2 \cdot \partial_z g_1 \cdot \partial_x f) + + (\partial_z f \cdot \partial_x g_1 \cdot \partial_y g_2 - \partial_z g_2 \cdot \partial_x g_1 \cdot \partial_y f).$$

Evidentně je výraz výše zcela nezapamatovatelný. Naštěstí si ho lze snadno zapamatovat přes následující odvození.



Všechna řešení této soustavy rovnic výše přidáme do seznamu kandidátů extrémů funkce f v množině M;

– **Metoda Lagrangeových multiplikátorů** - metoda pro funkce více proměnných (pro ná dvou nebo tří). Uvažujeme hranici množiny zadanou implicitně pomocí až dvou rovnic $g_1(x,y) = 0, g_2(x,y) = 0$ (my potkáme jen příklady kdy N = 1 nebo N = 2, protože tři

vazby už i v \mathbb{R}^3 určují jediný bod a tedy ho rovnou můžeme zařadit na seznam kandidátů a nemusíme se trápit s výpočty). Tato metoda je založená na tzv. **Lagrangeově funkci** \mathcal{L} . Ta závisí na všech proměnných funkce f (tedy na x, y a případně z) a zároveň každá z vazeb g_i přidává této funkce \mathcal{L} jednu novou proměnnou λ_i - tzv. **Lagrangeův** multiplikátor. Tato funkce \mathcal{L} má vždy stejný tvar:

Pro dvě proměnné:
$$\mathcal{L}(x, y, \lambda) = f(x, y) + \lambda g(x, y)$$

Pro tři proměnné: $\mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2) = f(x, y, z) + \lambda_1 g_1(x, y, z) + \lambda_2 g_2(x, y, z)$

Vidímě, že definice není příliš složitá. Všimněme si, toho, že ačkoliv píšeme $g_i(x, y, z)$ tak funkce určující vazby nemusí nutně záviset na všech proměnných. Zároveň můžeme mít pouze jednu vazebnou rovnici. Pak tentopřípad lze zahrnout do definice výše jako speciální případ $g_2 \equiv 0$. Nebo-li máme-li jen jednu vazbu, automaticky přecházíme k $\mathcal{L}(x, y, z, \lambda) = f(x, y, z) + \lambda g(x, y, z)$.

To co nám metoda Lagrangeových multiplikátorů říká, je, že stačí zahrnout do seznamu kandidátů pouze body, které řeší soustavu rovnic

Pro dvě proměnné

$$\partial_x \mathcal{L}(x, y, \lambda) = 0$$
$$\partial_y \mathcal{L}(x, y, \lambda) = 0$$
$$\partial_\lambda \mathcal{L}(x, y, \lambda) = 0$$

Pro tři proměnné

$$\partial_x \mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2) = 0$$

$$\partial_y \mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2) = 0$$

$$\partial_z \mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2) = 0$$

$$\partial_{\lambda_1} \mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2) = 0$$

$$\partial_{\lambda_2} \mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2) = 0$$

Tím myslíme, body (x, y) (nebo (x, y, z)), pro které najdeme Lagrangeovy multiplikátory λ (nebo λ_1, λ_2), tak že v odpovídajícím bodě jsou všechny rovnice daného případu splněny.

Příklady Co se příkladů týče, tak vás opět musím odkázat na stránkypřednášejícího - Úkol 19 až Úkol 21. Je to opět z důvodu, že vymyslet příklad tohoto typu, který *rozumně vyjde* není jednoduché (alespoň pro mě ne), narozdíl od například příkladů na limity, asymptoty, kvadratické rovnice apod. Sem dám pouze jeden nebo dva typové příklady, abyste viděli tu abstrakci z úvodu v praxi. Co se samostudia týče - doporučuji sérii z cyklu Khan Academy věnované právě metodě Lagrangeových multiplikátorů.

Příklad 5, Úkol 19

Pro zadanou funkce f a množinu M určete extrémy f na M.

f(x,y) = 3x - y + 1 M je kruh se středem v počátku a poloměrem $\sqrt{10}$.

Řešení vnitřku Nejprve vyšetříme existenci kandidátů uvnitř dané množiny a množinu nakreslíme. Co se kreslení týče, to by neměl být ze zadání problém - $\sqrt{10}$ odhadneme jako o něco m'alo víc než 3 (protože $\sqrt{9}=3$). Zároveň však musíme mít analytick'e vyjádření této množiny. Tedy musíme vědět, že takovýto kruh se dá zapsat jako

$$M = \left\{ [x, y] \mid x^2 + y^2 \le \underbrace{10}_{=\sqrt{10}^2} \right\}.$$

To je důležité pro ověřování, zda nějaký bod $B = [\alpha, \beta]$ leží v této množině. To se pozná tak, že zkusíme dosadit $[\alpha, \beta]$ za [x, y] v M. Pokud pak spočtená nerovnost platí, bod B je v množině M. Navíc tento bod bude na hranici M, pokud bude platit přímo rovnost a bude uvnitř množiny M, pokud bude platit ostrá nerovnost. Pokud daná nerovnost neplatí, pak tento bod není uvnitř množiny M. Například bod [2;1] patří do této množiny a navíc je vnitřním bodem, protože $2^2+1^2<10$. Bod [1;3] patří do množiny a je na hranici, protože $3^2+1^2=10$ a bod [-3;2] nepatří do naší množiny M protože $(-3)^2+2^2>10$.

Budeme-li nyní hledat stacionární body funkce f, musíme nejprve spočíst parciální derivace. Snadno vidíme, že

$$\partial_x f(x,y) = 3$$
 $\partial_y f(x,y) = -1$

a tedy neexistuje žádný stacionární bod v celém definičním oboru a tím spíš ani v naší množině M. Zbývá tedy hledat extrémy na hranici - tzv. vázané extrémy. Ještě než k tomu přistoupíme, určíme tzv. $vazebnou\ funkci\ g(x,y)$. Tato funkce je vždy taková (je definována tak), že popisuje hranici množiny M - ve smyslu

hranice
$$M = \{ [x, y] | g(x, y) = 0 \}.$$

V našem případě je tato funkce zjevně tvaru $g(x,y) = x^2 + y^2 - 10$.

Řešení vázaných extrémů metodou Jakobiánu Máme hledat body, které splňují rovnice

$$\partial_x f(x,y) \cdot \partial_y g(x,y) - \partial_y f(x,y) \cdot \partial_x g(x,y) = 0$$

 $g(x,y) = 0.$

Parciální derivac funkce f již máme spočtené a je tedy zapotřebí spočíst paricální derivace g:

$$\partial_x g(x,y) = 2x \quad \partial_u g(x,y) = 2y.$$

Po dosazení do obecného tvaru dostáváme soustavu rovnic

$$3 \cdot 2y - (-1) \cdot 2x = 0$$
$$x^2 + y^2 = 10,$$

kterou lze snadno řešit vyjádřením z první rovnice a dosazením do druhé. Pokud vyjádříme x=-3y a dosadíme, dostaneme kvadratickou rovnici

$$9y^2 + y^2 = 10,$$

která má zjevně právě dvě řešení $y_1 = -1$ (a tedy $x_1 = 3$) a $y_2 = 1$ (a tedy $x_2 = -3$). Z celé hranice máme tedy dva kandidáty na extrém a to body [-1;3] a [1;-3].

Protože na vnitřku celé množiny není žádný stacionární bod, má celá funkce na M pouze dva kandidáty na extrémy a tedy jeden t nich musí být maximum a druhý minimum. Pokud funkci vyčíslíme, dostaneme

$$f(-3,1) = 3(-3) - 1 + 1 = -9$$
 $f(3,-1) = 3 \cdot 3 - (-1) + 1 = 11$

a tedy [-3,1] je minimem f na M a [3,-1] je maximem f na M.

Řešení vázaných extrémů metodou Lagrangeových multiplikátorů Zadefinujeme si lagrangeovu funkci jak to bylo uvedeno výše, tedy

$$\mathcal{L}(x, y, \lambda) = 3x - y + 1 + \lambda(x^2 + y^2 - 10).$$

Dále si spočítáme parciální derivace \mathcal{L} podle všech proměnných a sestavíme příslušnou soustavu rovnic

$$\underbrace{3 + 2\lambda x}_{\partial_x \mathcal{L}(x, y, \lambda)} = 0$$

$$\underbrace{-1 + 2\lambda y}_{\partial_y \mathcal{L}(x, y, \lambda)} = 0$$

$$\underbrace{x^2 + y^2 - 10}_{\partial_{\lambda} \mathcal{L}(x, y, \lambda)} = 0.$$

Všechna řešení této soustavy jsou kandidáti (v našem případě jediní, protože nemáme žádné stacionární body uvnitř M) na extrémy f na M. Soustavu vyřešíme vyjádřením x z první rovnice $(x=-3/(2\lambda)), y$ ze druhé $(y=1/(2\lambda))$ a dosazením do poslední rovnice. To jde provést pouze pokud $\lambda \neq 0$. Ovšem rovnou vidíme, že pokud $\lambda = 0$, pak ani první ani druhá rovnice nejsou nikdy splněny, takže nutně $\lambda \neq 0$ (protože my víme, že nějací kandidáti existovat musí - spojitá funkce má an kompaktní množině extrémy). Uvedeným psotupem získáme rovnici pro λ tvaru

$$\left(\frac{-3}{2\lambda}\right)^2 + \left(\frac{1}{2\lambda}\right)^2 = 10.$$

Vynásobením celé rovnice λ^2 získáme kvadratickou rovnici pro λ tvaru

$$9 + 1 = 40\lambda^2$$

a tedy dostáváme dvě řešení - $\lambda_1 = -1/2$ a $\lambda_2 = 1/2$. Po zpětném dodsazení do vztahů $x = -3/(2\lambda)$ a $y = 1/(2\lambda)$ dostaneme stejná řešení jako výše v metodě jakobiánu.

Porovnání

Obecně nelze říci, která metoda bude snazší, ale většinou platí, že metoda jakobiánu dává u jednoduchých příkladů snazší soustavy rovnic. Naopak u složitějšíh případů dáva soustavy jen těžko řešitelné, na které je zapotřebí často znát nějaký další trik. Co se týče matody lagrangeových

multiplikátorů, vždy lze postupovat jako výše - vyjádřit prostorové neznámé (x,y) a případně z) pomocí λ a řešíme následně orvnici pro λ . Navíc u metody Jakobiánu je velmi snadné poplést znaménko, což pak úplně zkazí celý výsledek, přestože budete počítat správně. Metoda lagrangeových multiplikátorů je lépe zapametovatelné.

Obecně bych řekl - pokud v parciálních derivacích f je nejvýše lineární člen a zároveň se nevyskytuje smíšený člen xy, použijte metodu jakobiánu. Jinak metodu lagrangeových multiplikátorů. Pokud vám vyjde ošklivá soustava, před počítáním doporučuji si zkusit napsat druhou variantu a zamyslet se na chvilku nad tím, zda by druhá varianta nebyla snazší. Alternativa je spočíst vždy vše pouze akrze lagrangeovy multiplikátory s tím, že občas si malinko přiděláte práci, ale nemusíte řešit více vzorečků apod.

Příklad 5.B, Úkol 21

Pro zadanou funkce f a množinu M určete extrémy f na M.

$$f(x,y,z) = x^2 - 2x + y^2 + z^2 + 4 \quad M = \{ [x,y,z] \mid (x-1)^2 + y^2 = 13 \& 3x + 2y - z + 12 = 0 \}.$$

Řešení metodou Lagrangeových multiplikátorů Podle návodů výše bychom nejprve měli určit stacionární body f uvnitř M. Ale, když se pozorněji podíváme, vidíme, že kdybychom našli nějaké stacionární body a chtěli ověřit, zda jsou uvnitř M, nevěděli bychom jak to udělat, protože M je zadána pomocí dvou rovností a žádné nerovnosti (a my víme, že rovnosti odpovídají hranicím nikoliv vnitřku). To je proto, že naše množina M v \mathbb{R}^3 je 1D - je to přibližně řečeno kruh protnutý s přímkou (první rovnice je rovnice kruhu a druhá rovnice je rovnice přímky). Tedy tato množina nemá žádný vnitřek - je to úsečka (nebo bod nebo prázdná množina - ale to by byl zadávající hodně podlý). Nicméně, pro nás to znamená, že můžeme rovnou přijít k sestavování lagrangeovy funkce pro dvě vazebné funkce $g_1(x, y, z) = (x - 1)^2 + y^2 - 13$ a $g_2(x, y, z) = 3x + 2y - z + 12$:

$$\mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2) = x^2 - 2x + y^2 + z^2 + 4 + \lambda_1 \left((x - 1)^2 + y^2 - 13 \right) + \lambda_2 (3x + 2y - z + 12).$$

Rovnou tedy můžeme psát naši soustavu rovnic:

$$\underbrace{2x - 2 + \lambda_1 2(x - 1) + 3\lambda_2}_{=\partial_x \mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2)} = 0$$

$$\underbrace{2y + \lambda_1 2y + 2\lambda_2}_{=\partial_y \mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2)} = 0$$

$$\underbrace{2z - \lambda_2}_{=\partial_z \mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2)} = 0$$

$$\underbrace{(x - 1)^2 + y^2 - 13}_{\partial_{\lambda_1} \mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2)} = 0$$

$$\underbrace{3x + 2y - z + 12}_{\partial_{\lambda_2} \mathcal{L}(x, y, z, \lambda_1, \lambda_2)} = 0.$$

Tu bychom mohli řešit jako dříve - postup je uveden níže. Ovšem chytřejší by bylo dosadit třetí rovnici do páté a následně řešit pouze čtyři rovnice o čteřech neznámých. Trochu práce bychom si tím ušetřili (ale ne zas tolik). To je klasický rys těchto úloh - výsledná soustava je většinou nějakým "trikem" zjednodušitelná - vyplatí se tedy nejprve se zamyslet než člověk najede na kuchařkovitý přístup. Nicméně i ten nakonec vede k cíli, jen je o trochu pracnější. Níže uvádím ten šablonovitý postup, ať máte někde ten jednotný základ.

Soustavu tedy budeme řešit podobně jako dříve - z prvních tří rovnic vyjádříme proměnné x, y a z pomocí λ_2 a λ_2 a dosadíme do posledních dvou rovnic, které pak budeme řešit pro λ_1 a λ_2 . Vyjádření

- $2x + 2\lambda_1 x = 2 + 2\lambda_1 3\lambda_2$ a tedy $x = \frac{2+2\lambda_1 3\lambda_2}{2+2\lambda_1}$;
- $2y + \lambda_1 2y = -2\lambda_2$ a tedy $y = \frac{-2\lambda_2}{2+2\lambda_1}$;
- $z = \lambda_2/2$.

Úpravy výše jsou v pořádku pouze pokud $\lambda_1 \neq -1$ (pokud jsme nedělili nulou). Ovšem pokud by náhodou $\lambda_1 \neq -1$, pak nutně z druhé rovnice plyne, že $\lambda_2 = 0$ a tedy z = 0 (třetí rovnice). První rovnice je automaticky splněna a ze čtvrté a páté rovnice dopočítáme x a y. Konkrétně dostaneme

$$(x-1)^2 + y^2 - 13 = 0$$
$$3x/2 + 12 = -y$$

a dosazením z druhé rovnice do první dostaneme

$$x^{2} - 2x + 1 + 9x^{2}/4 + 36x + 144 - 13 = 0$$
$$13x^{2}/4 + 34x + 132 = 0$$
$$D = 34^{2} - 13 \cdot 132 < 0$$

a tedy dostáváme, že takové x neexistuje. Tedy nemůže nastat případ $\lambda_1 = -1$ a ted jsme tímto členem mohli dělit.

Po dosazení do posleních dvou rovnic získáme soustavu

$$\left(\frac{2+2\lambda_1-3\lambda_2}{2+2\lambda_1}-1\right)^2 + \left(\frac{-2\lambda_2}{2+2\lambda_1}\right)^2 - 13 = 0$$
$$3\frac{2+2\lambda_1-3\lambda_2}{2+2\lambda_1} + 2\frac{-2\lambda_2}{2+2\lambda_1} - \lambda_2/2 + 12 = 0$$

a tuto soustavu můžeme upravovat dále

$$\left(\frac{2+2\lambda_1 - 3\lambda_2 - 2 - 2\lambda_1}{2+2\lambda_1}\right)^2 + \left(\frac{-2\lambda_2}{2+2\lambda_1}\right)^2 - 13 = 0$$

$$\frac{6+6\lambda_1 - 9\lambda_2}{2+2\lambda_1} + \frac{-4\lambda_2}{2+2\lambda_1} - \lambda_2/2 + 12 = 0$$

a tedy

$$\frac{9\lambda_2^2}{(2+2\lambda_1)^2} + \frac{4\lambda_2^2}{(2+2\lambda_1)^2} - 13 = 0$$
$$\frac{6+6\lambda_1 - 13\lambda_2}{2+2\lambda_1} - \lambda_2/2 + 12 = 0$$

a tedy

$$13\lambda_2^2 - 13(2+2\lambda_1)^2 = 0$$
$$\frac{-13\lambda_2}{2+2\lambda_1} - \lambda_2/2 + 15 = 0.$$

Z první rovnice vidíme, že $\lambda_2=\pm(2+2\lambda_1)$ a tedy dosazením získáme dvě nezávislé rovnice pro λ_1 (jednu pro znaménko + a druhou pro -), které nám dají řešení λ_1^A a λ_1^B . K těmto pak dopočteme zbylé neznámé a získáme body $A=[x^A,y^A,z^A]$ a $B=[x^B,y^B,z^B]$ jako kandidáty na extrémy.

- (+) $\frac{-13(2+2\lambda_1)}{2+2\lambda_1}-(2+2\lambda_1)/2+15=0$ což lze snadno upravit do tvaru $-13-1-\lambda_1+15=0$ a tedy $\lambda_1^A=1$. Tudíž lze zpětně dopočíst, že $\lambda_2^A=4,\,z^A=2,\,y^A=-2$ a $x^A=-2.$
- (-) $\frac{13(2+2\lambda_1)}{2+2\lambda_1} (-1)(2+2\lambda_1)/2 + 15 = 0$ což lze snadno upravit do tvaru $13+1+\lambda_1+15 = 0$ a tedy $\lambda_1^B = -29$. Tudíž lze zpětně dopočíst, že $\lambda_2^B = 60$, $z^B = 28$, $y^B = 2$ a $x^B = 4$.

Dosazením do předpisu funkce dostaneme, že A je minimum a B maximum.

Řešení metodou Jakobiánu Pouze pro připomenutí - $g_1(x, y, z) = (x - 1)^2 + y^2 - 13$ a $g_2(x, y, z) = 3x + 2y - z + 12$ pro naší funkci $f(x, y, z) = x^2 - 2x + y^2 + z^2 + 4$. Stačí tedy sestavit soustavu.

(R1)

$$(\partial_x f \cdot \partial_y g_1 \cdot \partial_z g_2 - \partial_z f \cdot \partial_y g_1 \cdot \partial_x g_2) + \\
+ (\partial_y f \cdot \partial_z g_1 \cdot \partial_x g_2 - \partial_y g_2 \cdot \partial_z g_1 \cdot \partial_x f) + \\
+ (\partial_z f \cdot \partial_x g_1 \cdot \partial_y g_2 - \partial_z g_2 \cdot \partial_x g_1 \cdot \partial_y f) = 0$$

$$(\text{R1}) \ \ (2x \cdot 2y \cdot (-1) - 3 \cdot 2y \cdot 2z) + (2y \cdot 0 \cdot 3 - 2 \cdot 0 \cdot (2x - 2)) + (2z \cdot 2(x - 1) \cdot 2 - (-1) \cdot 2(x - 1) \cdot 2y) = 0$$

$$(R1_{uprav.}) (2x \cdot 2y \cdot (-1) - 3 \cdot 2y \cdot 2z) + (2z \cdot 2(x-1) \cdot 2 - (-1) \cdot 2(x-1) \cdot 2y) = 0$$

$$(R1_{uprav.1}) -4xy - 12zy + 8zx - 8z + 4xy - 4y = 0$$

$$(R1_{uprav.1}) -12zy + 8zx - 8z - 4y = 0$$

(R2)
$$(x-1)^2 + y^2 - 13 = 0$$

(R3)
$$3x + 2y - z + 12 = 0$$

Příklady pro zvídavé

Vyšetřete extrémy dané funkce f(x,y) na množině zadané implicitně rovnicí g(x,y)=0.

•
$$f(x,y) = 5x - 2y + 3$$
 a $g(x,y) = 4x^2 + y^2 - 164$;