

工業数学 A3

更新日時：2021 年 6 月 1 日

目次

1	フーリエ級数展開	2
1.1	導入	2
1.2	三角関数の直交関係とフーリエ係数	2
1.3	複素フーリエ変換	3
1.4	いくつかの実例	4
1.5	フーリエ級数の一様収束	5
1.6	有限フーリエ級数	5
1.7	有限フーリエ変換の連続極限	6
1.8	関数空間の内積と直交関数系	8
1.9	正規直交基底とフーリエ級数の平均収束	9
1.10	定理 1.3 の証明	13
1.11	ギブス現象と総和法	15

1 フーリエ級数展開

1.1 導入

$f(t)$ を \mathbb{R} 上の関数とする ($t \in \mathbb{R}$).

定義: 周期関数

f が周期 T の周期関数であるとは, $\forall t \in \mathbb{R}$ に対して

$$f(t+T) = f(t) \quad (t \in \mathbb{R})$$

が成り立つこと.

このとき, $\forall n \in \mathbb{Z}$ に対して

$$f(t+nT) = f(t) \quad (t \in \mathbb{R})$$

が成り立つ.

定義: フーリエ級数展開

$$f(t) = c + \sum_{n=1}^{\infty} a[n] \cos(n\omega t) + \sum_{n=1}^{\infty} b[n] \sin(n\omega t) \quad (1.1)$$

ここで $\omega = 2\pi/T$, $c, a[n], b[n]$ は定数.

これが収束すれば周期 T の周期関数である. 広いクラスの, 周期 T の周期関数は (1.1) の形に表現できる.

1.2 三角関数の直交関係とフーリエ係数

(1.1) における $c, a[n], b[n]$ をフーリエ係数とよぶ.

定理 1.1: 三角関数の直交関係

n, m を正の整数とする.

$$\frac{2}{T} \int_0^T \cos(n\omega t) \cos(m\omega t) dt = \delta_{nm} \quad (1.2)$$

$$\frac{2}{T} \int_0^T \sin(n\omega t) \sin(m\omega t) dt = \delta_{nm} \quad (1.3)$$

$$\frac{2}{T} \int_0^T \sin(n\omega t) \cos(m\omega t) dt = 0 \quad (1.4)$$

$$\frac{2}{T} \int_0^T \cos(n\omega t) dt = \frac{2}{T} \int_0^T \sin(n\omega t) dt = 0 \quad (1.5)$$

ここで, δ_{nm} はクロネッカーのデルタである.

証明 省略. ■

公式 1.2 周期 T の周期関数 $f(t)$ が

$$f(t) = \frac{a[0]}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} a[n] \cos(n\omega t) + \sum_{n=1}^{\infty} b[n] \sin(n\omega t) \quad (1.6)$$

と表されるならば、フーリエ係数は

$$a[n] = \frac{2}{T} \int_0^T f(t) \cos(n\omega t) dt \quad (n = 0, 1, 2, \dots) \quad (1.7)$$

$$b[n] = \frac{2}{T} \int_0^T f(t) \sin(n\omega t) dt \quad (n = 0, 1, 2, \dots) \quad (1.8)$$

と与えられる。

周期性により

$$a[n] = \frac{2}{T} \int_{-T/2}^{T/2} f(t) \cos(n\omega t) dt \quad (n = 0, 1, 2, \dots) \quad (1.9)$$

$$b[n] = \frac{2}{T} \int_{-T/2}^{T/2} f(t) \sin(n\omega t) dt \quad (n = 0, 1, 2, \dots) \quad (1.10)$$

とかける。 f が偶関数ならば $b[n] = 0$ ($n = 0, 1, 2, \dots$) となり、 **余弦フーリエ級数展開**:

$$f(t) = \frac{a[0]}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} a[n] \cos(n\omega t)$$

f が奇関数ならば $a[n] = 0$ ($n = 0, 1, 2, \dots$) となり、 **正弦フーリエ級数展開**:

$$f(t) = \sum_{n=1}^{\infty} b[n] \sin(n\omega t)$$

をもつといわれる。

1.3 複素フーリエ変換

オイラーの公式を用いれば、フーリエ級数展開 (1.6) は

$$f(t) = \frac{a[0]}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} \left(\frac{a[n]}{2} + \frac{b[n]}{2i} \right) e^{in\omega t} + \sum_{n=1}^{\infty} \left(\frac{a[n]}{2} - \frac{b[n]}{2i} \right) e^{-in\omega t}$$

となる。そこで

$$c[n] = \begin{cases} a[0]/2 & (n = 0) \\ (a[n] - ib[n])/2 & (n > 0) \\ (a[-n] + ib[-n])/2 & (n < 0) \end{cases}$$

とすると **複素フーリエ変換**:

$$f(t) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} c[n] e^{in\omega t} \quad (1.11)$$

が得られる。公式 1.2 もしくは直接計算により

$$c[n] = \frac{1}{T} \int_0^T f(t) e^{-in\omega t} dt \quad (n \in \mathbb{Z})$$

が確かめられる。

1.4 いくつかの実例

例 1.1: 三角多項式

三角多項式 ($\sin \omega t, \cos \omega t$ の多項式).

例えば

$$f_1(t) = (\cos \omega t)^3 = \frac{3}{4} \cos \omega t + \frac{1}{4} \cos 3\omega t$$

一般的な三角多項式に対しては, $N \in \mathbb{N}$ が存在して

$$f(t) = \sum_{n=-N}^N c[n] e^{in\omega t}$$

の形にかけらる.

例 1.2: 三角波

$$f_2(t) = |T| \quad (|t| \leq T/2)$$

$f_2(t)$ は偶関数であるから, 余弦フーリエ級数展開をもち

$$a[n] = \frac{2}{T} \int_{-T/2}^{T/2} |t| \cos(n\omega t) dt = \frac{4}{T} \int_0^{T/2} t \cos(n\omega t) dt$$

$n = 0$ のとき

$$a[0] = \frac{4}{T} \left[\frac{t^2}{2} \right]_0^{T/2} = \frac{T}{2}$$

$n \neq 0$ のとき

$$a[n] = \begin{cases} 0 & (n \text{ は偶数}) \\ -\frac{4}{\pi n^2 \omega} & (n \text{ は奇数}) \end{cases}$$

つまり, $f_2(t)$ のフーリエ級数展開は

$$f_2(t) = \frac{T}{4} - \frac{4}{\pi \omega} \sum_{m=0}^{\infty} \frac{1}{(2m+1)^2} \cos\{(2m+1)\omega t\}$$

となる.

例 1.3

$$f_3(t) = \frac{1}{\frac{5}{4} + \cos \omega t}$$

留数定理を用いてフーリエ係数を計算すると, $n \geq 0$ として

$$c[-n] = \frac{4}{3} (-2)^n$$

$n > 0$ として $c[n] = c[-n]$ より

$$c[n] = \frac{4}{3} (-2)^{-n}$$

となるから、 $f_3(t)$ のフーリエ級数展開は

$$f_3(t) = \frac{4}{3} + \frac{8}{3} \sum_{n=1}^{\infty} (-2)^n \cos(n\omega t)$$

となる。

1.5 フーリエ級数の一様収束

定義: リプシッツ連続 (Lipshitz continuous)

\mathbb{R} 上の関数 $f(t)$ がリプシッツ連続であるとは、

$$\exists C > 0 \text{ s.t. } \forall t, s \in \mathbb{R}, |f(t) - f(s)| \leq C|t - s|$$

が成り立つことである。

定理 1.3 $f(t)$ がリプシッツ連続ならば、フーリエ級数展開は $f(t)$ に一様収束する。

証明 は後回し。 ■

1.6 有限フーリエ級数

$X = \mathbb{C}^N$ を N 次元複素線形空間とする。 X の元を $u = (u[0], u[1], \dots, u[N-1]) \in X$ と書く。

定義: エルミート内積

$u, v \in X$ のエルミート内積:

$$\langle u, v \rangle = \sum_{n=0}^{N-1} u[n] \overline{v[n]}$$

定義: 長さ

$u \in X$ の長さ:

$$|u| = \sqrt{\langle u, u \rangle}$$

定義: 正規直交系/正規直交基底

$u_0, \dots, u_{M-1} \in X$ が正規直交系であるとは

$$\langle u_m, u_n \rangle = \delta_{mn} \quad (n, m = 0, 1, \dots, M-1)$$

が成り立つこと。

$M = N = \dim X$ のとき正規直交基底とよばれ、 $\forall u \in X$ は

$$u = \sum_{n=0}^{N-1} \langle u, u_n \rangle u_n$$

と直交分解できる。 \mathbb{C}^N の標準的な基底 $e_n[k] = \delta_{kn}$ ($n, k = 0, \dots, N-1$) は正規直交基底である。

有限フーリエ変換の定義に用いられる正規直交基底は、 $\alpha = 2\pi/N$ として

$$\varphi_n[k] = \frac{1}{\sqrt{N}} \exp(i\alpha nk) \quad (n, k = 0, 1, \dots, N-1)$$

で定義される.

命題 1.4 $\{\varphi_0, \dots, \varphi_{N-1}\}$ は $X(=\mathbb{C}^N)$ の正規直交基底である.

証明 $n = m$ のとき

$$|\varphi_n|^2 = \langle \varphi_n, \varphi_n \rangle = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} |e^{i\alpha nk}|^2 = 1$$

$n \neq m$ のとき

$$\langle \varphi_n, \varphi_m \rangle = \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} e^{i\alpha nk} e^{-i\alpha mk} = \frac{1}{N} \frac{1 - e^{i\alpha(n-m)N}}{1 - e^{i\alpha(n-m)}} = 0$$

\uparrow
 $\alpha N = 2\pi$

$u \in X$ に対して**有限フーリエ変換**:

$$\hat{u}[n] = \langle u, \varphi_n \rangle = \frac{1}{\sqrt{N}} \sum_{k=0}^{N-1} u[k] e^{-i\alpha nk} \quad (n = 0, \dots, N-1) \quad (1.12)$$

とくと、**有限フーリエ級数展開** ($\hat{u}[n]$ の**逆有限フーリエ変換**):

$$u[k] = \sum_{n=0}^{N-1} \hat{u}[n] \varphi_n[k] = \frac{1}{\sqrt{N}} \sum_{n=0}^{N-1} \hat{u}[n] e^{i\alpha nk} \quad (n = 0, \dots, N-1) \quad (1.13)$$

と直交展開される.

有限フーリエ変換、逆有限フーリエ変換はユニタリーな線形変換である. すなわち:

$$|u| = |\hat{u}| \quad (1.14)$$

が成り立つ. これは

$$\langle u, v \rangle = \langle \hat{u}, \hat{v} \rangle \quad (1.15)$$

であることから従う.

1.7 有限フーリエ変換の連続極限

定理 1.5 $f(t)$ を周期 T のリプシッツ連続な周期関数とし、 $\omega = 2\pi/T, \alpha = 2\pi/N$ とする.

$$f_N(t) = \sum_{-N/2 \leq n < N/2} c_N[n] e^{i\alpha nt}$$

$$c_N[n] = \frac{1}{N} \sum_{m=0}^{N-1} f\left(\frac{m}{N}T\right) e^{-i\alpha nm} \quad (n \in \mathbb{Z})$$

と定める. このとき、 $f_N(t)$ は $f(t)$ に一様収束する.

注意 1.1

$$f_N\left(\frac{k}{N}T\right) = \sum_{-N/2 \leq n < N/2} c_N[n] e^{i\alpha n k} = \sum_{n=0}^{N-1} e_N[n] e^{i\alpha n k} = f\left(\frac{k}{N}T\right)$$

$f_N(t)$ は $f(t_k)$ の値を与えたときの補間.

証明 まず

$$d_N[n] = \frac{1}{N} \sum_{m=0}^{N-1} \left\{ f\left(\frac{m}{N}T\right) - f\left(\frac{m-1}{N}T\right) \right\} e^{-i2\pi(m/N)n}$$

とおく. $\{d_N[n]\}$ は $f(t_n) - f(t_n - (T/N))$ の有限フーリエ変換の $1/\sqrt{N}$ 倍である. リプシッツ連続性の仮定より, $\exists C > 0$,

$$\left| f\left(\frac{m}{N}T\right) - f\left(\frac{m-1}{N}T\right) \right| \leq \frac{C}{N} \quad (m \in \mathbb{Z})$$

が成り立つ. したがって有限フーリエ変換の等長性 (1.14) より

$$N \sum_{k=0}^{N-1} |d_N[k]|^2 \leq \sum_{m=0}^{N-1} \left| \frac{C}{N} \right|^2 = \frac{C^2}{N}$$

すなわち

$$\sum_{k=0}^{N-1} |d_N[k]|^2 \leq \frac{C^2}{N^2}$$

が従う. 一方, $d_N[k]$ の定義により

$$d_N[k] = (1 - e^{-i2\pi(k/N)}) c_N[k] = 2ie^{-i\pi(k/N)} \sin(\pi k/N) c_N[k]$$

これとジョルダンの不等式:

$$|\sin \theta| \geq \frac{2}{\pi} |\theta| \quad (|\theta| \leq \pi/2) \quad (1.16)$$

を用いれば

$$|d_N[k]| \geq \frac{4|k|}{N} |c_N[k]| \quad \left(-\frac{N}{2} \leq k < \frac{N}{2}\right)$$

が従う. $d_N[k]$ が周期 N を持つことに注意して, これらを組み合わせると

$$\sum_{-N/2 \leq k < N/2} |k|^2 |c_N[k]|^2 \leq \frac{C^2}{16}$$


が導かれる.

また,

$$f'_N(t) = \sum_n i\omega n c_N[n] e^{i\omega n t}$$

の絶対値を考えると

$$\begin{aligned} |f'_N(t)| &\leq \omega \sqrt{N} \sum_n \frac{n}{\sqrt{N}} |c_N[n]| \\ &\leq \omega \sqrt{N} \left(\sum_n \left(\frac{1}{\sqrt{N}} \right)^2 \right)^{1/2} \left(\sum_n |n|^2 |c_N[n]|^2 \right)^{1/2} \\ &\leq \sqrt{N} C' \quad (C' \text{ はある定数}) \end{aligned} \quad (1.17)$$

Schwarz の不等式 

となる。さて、 $\forall t \in [0, T]$ に対して $|t - t_k| \leq T/(2N)$ であるような $t_k = (k/N)T$ が存在する。 $f(t_k) = f_N(t_k)$ に注意して (注意 1.1)

$$f(t) - f_N(t) = (f(t) - f(t_k)) + (f_N(t_k) - f_N(t))$$

と分解して考える。 $f(t)$ のリプシッツ連続性と f'_N の微分の評価 (1.17) から

$$\begin{aligned} |f(t) - f_N(t)| &\leq |f(t) - f(t_k)| + |f_N(t_k) - f_N(t)| \\ &\leq C|t - t_k| + \underbrace{C'\sqrt{N}}_{\text{リプシッツ連続性}} \underbrace{|t - t_k|}_{\text{平均値の定理}} \\ &= O(1/\sqrt{N}) \end{aligned}$$

が得られる。つまり、 $N \rightarrow \infty$ のとき $f_N(t)$ が $f(t)$ に一様収束することが示された。 ■

1.8 関数空間の内積と直交関数系

X を周期 T で周期的で有界かつ $[0, T]$ 上で積分可能な関数全体とする。

定義: 内積

$f, g \in X$ に対して内積を

$$\langle f, g \rangle = \frac{1}{T} \int_0^T f(t) \overline{g(t)} dt$$

で定義する。

$f, g, h \in X$, $a, b \in \mathbb{C}$ のとき

$$\langle af + bg, h \rangle = a\langle f, h \rangle + b\langle g, h \rangle$$

$$\langle f, ag + bh \rangle = \bar{a}\langle f, g \rangle + \bar{b}\langle f, h \rangle$$

$$\langle f, g \rangle = \overline{\langle g, f \rangle}$$

定義: L^2 ノルム

$f \in X$ に対して

$$\|f\| = \sqrt{\langle f, f \rangle} \geq 0$$

$\|f\| = 0 \Leftrightarrow f = 0$ μ -a.e. である。

シュワルツの不等式

$$|\langle f, g \rangle| \leq \|f\| \|g\| \quad (1.18)$$

三角不等式

$$\|f + g\| \leq \|f\| + \|g\| \quad (1.19)$$

定義: 直交

f, g が直交するとは,

$$\langle f, g \rangle = 0$$

となること。

定義: 直交関数系

$\{f_n\}_{n=1}^{\infty} \subset X$ が正規直交系であるとは,

$$\langle f_n, f_m \rangle = \delta_{nm} \quad (n, m = 1, 2, \dots)$$

となること.

フーリエ関数系を

$$\varphi_n(t) = e^{in\omega t} \quad (n \in \mathbb{Z}, t \in \mathbb{R})$$

で定義すると, $\{\varphi_n\}_{n=-\infty}^{\infty}$ は正規直交系となる. このとき, フーリエ級数展開

$$f(t) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} c[n] \varphi_n(t)$$

$$c[n] = \langle f, \varphi_n \rangle = \frac{1}{T} \int_0^T f(t) e^{-in\omega t} dt \quad (n \in \mathbb{Z})$$

は正規直交系 $\{\varphi_n\}$ に関する展開であり, フーリエ係数は座標成分である. 実フーリエ級数 (1.6) も同様である.

1.9 正規直交基底とフーリエ級数の平均収束

$\{f_n\}_{n=1}^{\infty}$ を X の正規直交系とする.

定義: 正規直交基底 (完全正規直交系)

$\{f_n\}_{n=1}^{\infty}$ が正規直交基底もしくは完全正規直交系であるとは, $\forall f \in X$ に対して

$$\lim_{N \rightarrow \infty} \left\| f - \sum_{n=1}^N \langle f, f_n \rangle f_n \right\| = 0$$

であること.*¹

定理 1.6: パーセバルの等式

フーリエ関数系 $\{\varphi_n\}_{n=-\infty}^{\infty}$ は X の正規直交基底で, $\forall f \in X, c[n] = \langle f, \varphi_n \rangle$ として

$$\|f\|^2 = \sum_{n=-\infty}^{\infty} |c[n]|^2 \quad (1.20)$$

が成り立つ.

証明 はあとで. ■

*¹ ちなみに, 完全のつかない正規直交系として $\{\cos x, \cos 2x, \dots, \sin x, \sin 2x, \dots\}$ が考えられる. これは例えば f に定数をとればわかるように, 完全正規直交系 (正規直交基底) にはならない. $\{1, \cos x, \cos 2x, \dots, \sin x, \sin 2x, \dots\}$ なら完全正規直交系 (正規直交基底) になる.

定理 1.6 より, フーリエ級数展開の**平均収束 (L^2 -収束)** :

$$\left\| f - \sum_{n=-N}^N c[n] \varphi_n \right\| \rightarrow 0 \quad (N \rightarrow \infty)$$

がわかる.

命題 1.7: ベッセルの不等式

$\{f_n\}_{n=1}^{\infty}$ が正規直交系ならば, $\forall f \in X$ に対して

$$\sum_{n=1}^{\infty} |\langle f, f_n \rangle|^2 \leq \|f\|^2 \quad (1.21)$$

が成り立つ.

証明

$$\begin{aligned} \left\| f - \sum_{n=1}^N \langle f, f_n \rangle f_n \right\|^2 &= \left\langle f - \sum_{n=1}^N \langle f, f_n \rangle f_n, f - \sum_{n=1}^N \langle f, f_n \rangle f_n \right\rangle \\ &= \|f\|^2 - \sum_{n=1}^N \langle f, f_n \rangle \langle f_n, f \rangle - \sum_{n=1}^N \overline{\langle f, f_n \rangle} \langle f_n, f \rangle + \sum_{n=1}^N \sum_{m=1}^N \langle f, f_n \rangle \overline{\langle f, f_m \rangle} \langle f_n, f_m \rangle \\ &= \|f\|^2 - \sum_{n=1}^N |\langle f, f_n \rangle|^2 \\ &\geq 0 \end{aligned}$$

より結論を得る. ■

命題 1.8 $\{f_n\}_{n=1}^{\infty}$ を正規直交系とする. $\{f_n\}_{n=1}^{\infty}$ が正規直交基底であるための必要十分条件は, $\forall f \in X$ について

$$\|f\|^2 = \sum_{n=1}^{\infty} |\langle f, f_n \rangle|^2$$

が成り立つことである.

証明 命題 1.7 をみると, $\{f_n\}$ が正規直交基底ならば

$$\left\| f - \sum_{n=1}^N \langle f, f_n \rangle f_n \right\|^2 = \|f\|^2 - \sum_{n=1}^N |\langle f, f_n \rangle|^2 \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$$

が成り立つ. 逆に,

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \left(\|f\|^2 - \sum_{n=1}^N |\langle f, f_n \rangle|^2 \right) = 0$$

ならば

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \left\| f - \sum_{n=1}^N \langle f, f_n \rangle f_n \right\|^2 = 0$$

であることがわかり, $\{f_n\}$ は正規直交基底である. ■

補題 1.9 $\{f_n\}$ を正規直交系, $a_1, a_2, \dots, a_N \in \mathbb{C}$, $f \in X$ とする. このとき

$$\left\| f - \sum_{n=1}^N \langle f, f_n \rangle f_n \right\| \leq \left\| f - \sum_{n=1}^N a_n f_n \right\| \quad (1.22)$$

が成り立つ.

証明 $g = f - \sum_{n=1}^N \langle f, f_n \rangle f_n$ とする. $\langle g, f_n \rangle = 0$ に注意すると

$$\begin{aligned} \left\| f - \sum_{n=1}^N a_n f_n \right\|^2 &= \left\| g + \sum_{n=1}^N (\langle f, f_n \rangle - a_n) f_n \right\|^2 \\ &= \|g\|^2 + \left\langle g, \sum_{n=1}^N (\langle f, f_n \rangle - a_n) f_n \right\rangle + \left\langle \sum_{n=1}^N (\langle f, f_n \rangle - a_n) f_n, g \right\rangle + \left\| \sum_{n=1}^N (\langle f, f_n \rangle - a_n) f_n \right\|^2 \\ &= \|g\|^2 + \left\| \sum_{n=1}^N (\langle f, f_n \rangle - a_n) f_n \right\|^2 \\ &\geq \|g\|^2 \end{aligned}$$

となる. ■

命題 f を周期 T で周期的かつ有界で $[0, T]$ 上で積分可能な関数とする. 任意の $\varepsilon > 0$ に対して $\|f - g\| < \varepsilon$ となるリプシッツ連続な周期関数 g が存在する.*¹

証明 区間 $[0, T]$ の分割 $\Delta: 0 = t_0 < t_1 < \dots < t_n = T$ をとり, 周期 T で周期的な階段関数 $f_\Delta(t)$ を次式により定める:

$$f_\Delta(t) = \inf_{t_j \leq t < t_{j+1}} f(t) \quad (t_j \leq t < t_{j+1} \text{ のとき})$$

Δ を十分細かく取れば, 積分の定義により

$$\|f - f_\Delta\| = \frac{1}{T} \int_0^T |f(t) - f_\Delta(t)| dt < \frac{\varepsilon}{2} \quad (1)$$

とできる. 上式が成立するように Δ をとって固定する. また,

$$\lim_{s \rightarrow 0} \int_0^T |f_\Delta(t-s) - f_\Delta(t)| dt = 0$$

であるから, $n_0 > 0$ を十分大きくとれば, $n \geq n_0$ のとき

$$\sup_{|s| \leq 1/n} \frac{1}{T} \int_0^T |f_\Delta(t-s) - f_\Delta(t)| dt < \frac{\varepsilon}{2} \quad (2)$$

が成立する.

任意の $t \in \mathbb{R}$ に対して $\phi(t) \geq 0$ で, $|t| \geq 1$ のとき $\phi(t) = 0$ かつ

$$\int_{-1}^1 \phi(t) dt = 1$$

*¹ ルベーグ積分論を用いた証明としては L^2 空間における連続関数の稠密性が関係していそう. ルベーグ積分 (伊藤) の定理 24.2 など.

を満たすリプシッツ連続な関数 $\phi(t)$ をとり、 $\phi_n(t) = n\phi(nt)$ とする。このとき

$$|t| \geq 1/n \text{ のとき } \phi_n(t) = 0 \text{ かつ } \int_{-1/n}^{1/n} \phi_n(t) dt = 1 \quad (3)$$

となる。関数 $f_n(t)$ を次式により定める。

$$f_n(t) = \int_{-\infty}^{\infty} \phi_n(t-s) f_{\Delta}(s) ds = \int_{-1/n}^{1/n} \phi_n(s) f_{\Delta}(t-s) ds$$

$f_{\Delta}(t)$ の周期性より

$$f_n(T) = \int_{-1/n}^{1/n} \phi_n(s) f_{\Delta}(T-s) ds = \int_{-1/n}^{1/n} \phi_n(s) f_{\Delta}(-s) ds = f_n(0)$$

かつ、十分大きな $n > 0$ に対して、 L_{ϕ} を関数 ϕ のリプシッツ定数として

$$|f_n(t_1) - f_n(t_2)| \leq \int_{-\infty}^{\infty} |\phi_n(t_1-s) - \phi_n(t_2-s)| |f_{\Delta}(s)| ds \leq 4nL_{\phi}|t_1 - t_2| \sup_{0 \leq t \leq T} |f(t)|$$

となるから、 $f_n(t)$ は周期 T のリプシッツ連続な周期関数である。ここで、 $t_1 \neq t_2$ ならば、 $n > 0$ が十分大きいとき、

$$\max\left(t_1 - \frac{1}{n}, t_2 - \frac{1}{n}\right) > \min\left(t_1 + \frac{1}{n}, t_2 + \frac{1}{n}\right)$$

であること、および式 (3) より、

$$\begin{aligned} \int_{-\infty}^{\infty} |\phi_n(t_1-s) - \phi_n(t_2-s)| ds &\leq \int_{t_1-1/n}^{t_1+1/n} |\phi_n(t_1-s)| ds + \int_{t_2-1/n}^{t_2+1/n} |\phi_n(t_2-s)| ds \\ &= \int_{nt_1-1}^{nt_1+1} |\phi(nt_1-u)| du + \int_{nt_2-1}^{nt_2+1} |\phi(nt_2-u)| du \\ &\leq \int_{nt_1-1}^{nt_1+1} |\phi(nt_1-u) - \phi(nt_2-u)| du + \int_{nt_2-1}^{nt_2+1} |\phi(nt_1-u) - \phi(nt_2-u)| du \\ &\leq \int_{nt_1-1}^{nt_1+1} nL_{\phi}|t_1 - t_2| du + \int_{nt_2-1}^{nt_2+1} nL_{\phi}|t_1 - t_2| du \\ &\leq 4nL_{\phi}|t_1 - t_2| \end{aligned}$$

となることを用いた。

式 (3) より

$$f_n(t) - f_{\Delta}(t) = \int_{-1/n}^{1/n} \phi_n(s)(f_{\Delta}(t-s) - f_{\Delta}(t)) ds$$

であるから、

$$|f_n(t) - f_{\Delta}(t)| \leq \int_{-1/n}^{1/n} \phi_n(s) |f_{\Delta}(t-s) - f_{\Delta}(t)| ds$$

となる。さらに、上式を t で積分し、積分を交換すると、 $n \geq n_0$ のとき

$$\|f_n - f_{\Delta}\| \leq \frac{1}{T} \int_{-1/n}^{1/n} \phi_n(s) \int_0^T |f_{\Delta}(t-s) - f_{\Delta}(s)| dt ds < \frac{\varepsilon}{2}$$

が成立する。ここで、式 (2) と (3) を用いた。三角不等式により、上式と式 (1) とから、 $n \geq n_0$ のとき、

$$\|f - f_n\| \leq \|f - f_{\Delta}\| + \|f_{\Delta} - f_n\| < \varepsilon$$

となり、 $g = f_n$ とおけば結論を得る。 ■

注意 上の証明で関数 $\phi(t)$ を C^∞ に取れば, 近似関数 g は C^∞ 級となる.

定理 1.6: パーセバルの等式 (再掲)

フーリエ関数系 $\{\varphi_n\}_{n=-\infty}^\infty$ は X の正規直交基底で, $\forall f \in X, c[n] = \langle f, \varphi_n \rangle$ として

$$\|f\|^2 = \sum_{n=-\infty}^{\infty} |c[n]|^2 \quad (1.20)$$

が成り立つ.

証明 $f \in X, \forall \varepsilon > 0$ をとる. すると, 上の命題より, リプシッツ連続な周期関数 g で, $\|f - g\| < \varepsilon/2$ をみ出すものをとれる. すると, 定理 1.5 より, N を十分大きくとれば,

$$\left| g(t) - \sum_{|n| \leq N} c_N[n] \varphi_n(t) \right| < \frac{\varepsilon}{2} \quad (t \in [0, T])$$

が成り立つ*2. ここで $\{c_N[n]\}$ は

$$c_N[n] = \frac{1}{N} \sum_{m=0}^{N-1} g\left(\frac{m}{N}T\right) e^{-i2\pi(m/N)n} \quad (n \in \mathbb{Z})$$

である. これより

$$\left\| g - \sum_{|n| \leq N} c_N[n] \varphi_n \right\| < \frac{\varepsilon}{2}$$

がしたがう. ゆえに

$$\begin{aligned} \left\| f - \sum_{|n| \leq N} \langle f, \varphi_n \rangle \varphi_n \right\| &\leq \left\| f - \sum_{|n| \leq N} c_N[n] \varphi_n \right\| \\ &\stackrel{\text{補題 1.9}}{\leq} \|f - g\| + \left\| g - \sum_{|n| \leq N} c_N[n] \varphi_n \right\| \\ &< \varepsilon \end{aligned}$$

となる. ■

1.10 定理 1.3 の証明

補題 1.10 f を周期 T のリプシッツ連続な周期関数, $\{c[n]\}$ を f のフーリエ係数とする. このとき

$$\sum_{n=-\infty}^{\infty} |n|^2 |c[n]|^2 < \infty$$

が成り立つ.

*2 1.6 節で $\varphi_n = e^{in\omega t}$ で定めている.

証明 リプシッツ連続性より, $C > 0$ が存在して

$$|f(t+h) - f(t)| \leq C|h| \quad (t, h \in \mathbb{R})$$

が成り立つ. $N \geq 1$ に対して $h = T/2N$ とおき, f の h だけ差分関数を

$$g(t) = \frac{1}{h} \{f(t+h) - f(t)\} = \frac{2N}{T} \left\{ f\left(t + \frac{T}{2N}\right) - f(t) \right\}$$

と定義すれば, $|g(t)| \leq C$ である. g のフーリエ係数を $\{d[n]\}$ と書くことにしよう. すると,

$$\begin{aligned} d[n] &= \frac{1}{hT} \int_0^T \{f(t+h) - f(t)\} e^{-i\omega n t} dt \\ &= \frac{1}{h} (e^{i\omega n h} - 1) c[n] \\ &= \frac{2N}{T} e^{i\omega n h/2} \cdot 2i \sin\left(\frac{\pi n}{2N}\right) c[n] \end{aligned}$$

が成り立つ. g についてパーセバルの等式を用いれば

$$\|g\|^2 = \sum_{n=-\infty}^{\infty} |d[n]|^2 = \left(\frac{4N}{T}\right)^2 \sum_{n=-\infty}^{\infty} \left|\sin\left(\frac{\pi n}{2N}\right)\right|^2 |c[n]|^2$$

がわかる. 一方, (1.16) を用いると,

$$|n| \leq N \quad \text{ならば} \quad \left|\sin\left(\frac{\pi n}{2N}\right)\right| \geq \frac{2}{\pi} \cdot \frac{\pi n}{2N} = \frac{n}{N}$$

だから,

$$\|g\|^2 \geq \frac{16}{T^2} \sum_{n=-N}^N |n|^2 |c[n]|^2$$

を得る. $|g(t)|^2 \leq C^2$ だったので

$$\sum_{n=-N}^N |n|^2 |c[n]|^2 \leq \frac{T^2 C^2}{16}$$

がわかる. 右辺は N に依らないので, $N \rightarrow \infty$ として求める不等式が導かれる. ■

補題 1.11 f を周期 T のリプシッツ連続な周期関数, $\{c[n]\}$ を f のフーリエ係数とする. このとき

$$\sum_{n=-\infty}^{\infty} |c[n]| < \infty$$

が成り立つ.

証明 \mathbb{C}^N でのシュワルツの不等式から

$$\begin{aligned} \sum_{1 \leq |n| \leq N} |c[n]| &\leq \left(2 \sum_{n=1}^N \frac{1}{n^2}\right)^{1/2} \left(\sum_{1 \leq |n| \leq N} |n|^2 |c[n]|^2\right)^{1/2} \\ &\leq \left(2 \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^2}\right)^{1/2} \left(\sum_{n=-\infty}^{\infty} |n|^2 |c[n]|^2\right)^{1/2} \end{aligned}$$

がわかる. 右辺は補題 1.10 より, 有限の定数で N に依らない. したがって, $N \rightarrow \infty$ として補題の主張が成り立つ. ■

補題 1.12 f を周期 T の連続な周期関数, $\{c[n]\}$ を f のフーリエ係数とする.

このとき, $\sum_{n=-\infty}^{\infty} |c[n]| < \infty$ ならば, フーリエ部分和:

$$S_N(t) = \sum_{n=-N}^N c[n] e^{i\omega n t}$$

は $N \rightarrow \infty$ のとき f に一様収束する.

証明 $N < M$ とすると,

$$|S_N(t) - S_M(t)| \leq \sum_{N < |n| \leq M} |c[n]| \leq \sum_{|n| > N} |c[n]| \quad (1.23)$$

である. 仮定により, $N \rightarrow \infty$ のとき $\sum_{|n| > N} |c[n]| \rightarrow 0$ だから, (1.23) の右辺は 0 に収束する. つまり, 各 t ごとに, $\{S_N(t)\}$ はコーシー列であり, 極限が存在する. そこで $g(t) \equiv \lim_{N \rightarrow \infty} S_N(t)$ とおく. (1.23) で $M \rightarrow \infty$ とすると

$$|S_N(t) - g(t)| \leq \sum_{|n| > N} |c[n]|$$

となる. 右辺は t によらず, $N \rightarrow \infty$ のとき 0 に収束するのだから, $S_N(t)$ は g に一様収束することになる. これより $\|S_N - g\| \rightarrow 0$ が従う. 一方, 定理 1.6 より, $\|S_N - f\| \rightarrow 0$ だから, $f = g$ でなければならない. 以上により, S_N が f に一様収束することが示された. ■

注意 補題 1.12 は定理 1.3 よりも強い主張であり, 重要である.

注意 1.2 $\{g_N(t)\}$ を連続関数列で $N \rightarrow \infty$ のとき $g_N(t)$ は $g(t)$ に一様収束するならば, $g(t)$ は連続である.

定理 1.3: (再掲)

$f(t)$ がリプシッツ連続ならば, フーリエ級数展開は $f(t)$ に一様収束する.

証明 補題 1.11 と補題 1.12 から直ちに導かれる. ■

1.11 ギブス現象と総和法

連続じゃないけれども連続からは離れてない関数

定理 1.13 $f(t)$ を周期 T の周期関数で, $[0, T]$ 上では区分的に滑らか^aな関数であるとする. このとき, フーリエ部分和 $S_N(t)$ は

$$\lim_{N \rightarrow \infty} S_N(t) = \begin{cases} f(t) & (t: \text{連続}) \\ \frac{1}{2} \{f(t+0) + f(t-0)\} & (t: \text{不連続}) \end{cases}$$

が成り立つ.^b

^a $a_j (j = 1, \dots, n-1)$ であって, $f(t)$ は $[a_j, a_{j+1}]$ で C^1 級で, $f(a_j+0) (j < n)$, $f(a_j-0) (j > 0)$ となるものが存在する ($a_0 = 0, a_n = T$)

^b $f(t \pm 0) = \lim_{\varepsilon \rightarrow 0} f(t \pm \varepsilon)$

証明

$$\begin{aligned} S_N(t) &= \sum_{n=-N}^N c[n] e^{i\omega n t} \\ &= \sum_{n=-N}^N \left(\frac{1}{T} \int_0^T f(s) e^{-i\omega s} ds \right) e^{i\omega n t} \\ &= \frac{1}{T} \sum_{n=-N}^N \int_0^T f(s) e^{i\omega n(t-s)} ds \end{aligned}$$

と変形できる. $f(s)$ は \mathbb{R} 上の関数なので, $f(s) e^{i\omega n(t-s)}$ の虚部 $f(s) \sin\{n\omega(t-s)\}$ を積分したものは 0 になる. したがって

$$\lim_{N \rightarrow \infty} \frac{1}{T} \sum_{n=-N}^N \int_0^T f(s) \cos\{n\omega(t-s)\} ds = \begin{cases} f(t) & (t: \text{連続}) \\ \frac{1}{2} \{f(t+0) + f(t-0)\} & (t: \text{不連続}) \end{cases}$$

を示せばよい. ここで,

$$2 \sin \frac{\theta}{2} \cos k\theta = \sin \left(k + \frac{1}{2} \right) \theta - \sin \left(k - \frac{1}{2} \right) \theta$$

より

$$\sum_{k=0}^N \cos k\theta = \frac{\sin \left(N + \frac{1}{2} \right) \theta + \sin \frac{\theta}{2}}{2 \sin \frac{\theta}{2}}$$

両辺 $1/2$ を引いて

$$\frac{1}{2} + \sum_{k=1}^N \cos k\theta = \frac{\sin \left(N + \frac{1}{2} \right) \theta}{2 \sin \frac{\theta}{2}}$$

であること*3を利用すると

$$\begin{aligned} &\frac{1}{T} \sum_{n=-N}^N \int_0^T f(s) \cos\{n\omega(t-s)\} ds \\ &= \frac{1}{T} \int_0^T f(s) \sum_{n=-N}^N \cos\{n\omega(t-s)\} ds \\ &= \frac{2}{T} \int_0^T f(s) \frac{\sin \frac{(2N+1)\omega(t-s)}{2}}{2 \sin \frac{\omega(t-s)}{2}} ds \\ &= \frac{2}{T} \int_t^{t+T} f(s) \frac{\sin \frac{(2N+1)\omega(t-s)}{2}}{2 \sin \frac{\omega(t-s)}{2}} ds \quad \text{周期性の利用} \\ &= \frac{2}{T} \left(\int_t^{t+T/2} + \int_{t+T/2}^{t+T} \right) f(s) \frac{\sin \frac{(2N+1)\omega(t-s)}{2}}{2 \sin \frac{\omega(t-s)}{2}} ds \\ &= \frac{2}{T} \int_0^{\omega T/4} f(t+2u/\omega) \frac{\sin(2N+1)u}{\sin u} \frac{2}{\omega} du + \frac{2}{T} \int_0^{\omega T/4} f(t-2u/\omega) \frac{\sin(2N+1)u}{\sin u} \frac{2}{\omega} du \\ &= \frac{4}{\omega T} \int_0^{\omega T/4} f(t+2u/\omega) \frac{\sin(2N+1)u}{\sin u} du + \frac{4}{\omega T} \int_0^{\omega T/4} f(t-2u/\omega) \frac{\sin(2N+1)u}{\sin u} du \quad \text{-}u = \omega(t-s)/2, u = \omega(t-s)/2 \text{ と置換} \end{aligned}$$

*3 ちなみに, $D_n(x) = \sum_{k=-n}^n e^{ikx} = 1 + 2 \sum_{k=1}^n \cos(kx) = \sin\{(n+1/2)x\}/\sin(x/2)$ はディリクレ核とよばれ, これを用いると畳み込みを用いて $S_N(t)$ が表現できる.

ここまでの議論は $f(s) = 1$ としても成立していることに注意すると、不連続点 t では（連続点では $f(t+0) = f(t-0) = f(t)$ として考える）

$$\begin{aligned}
S_N(t) - \left[\frac{1}{2} \{f(t+0) + f(t-0)\} \right] &= \frac{4}{\omega T} \int_0^{\omega T/4} f(t+2u/\omega) \frac{\sin(2N+1)u}{\sin u} du + \frac{4}{\omega T} \int_0^{\omega T/4} f(t-2u/\omega) \frac{\sin(2N+1)u}{\sin u} du \\
&\quad - \frac{1}{2} \{f(t+0) + f(t-0)\} \left[\frac{4}{\omega T} \int_0^{\omega T/4} \frac{\sin(2N+1)u}{\sin u} du + \frac{4}{\omega T} \int_0^{\omega T/4} \frac{\sin(2N+1)u}{\sin u} du \right] \\
&= \frac{4}{\omega T} \int_0^{\omega T/4} \{f(t+2u/\omega) - f(t+0)\} \frac{\sin(2N+1)u}{\sin u} du \\
&\quad + \frac{4}{\omega T} \int_0^{\omega T/4} \{f(t-2u/\omega) - f(t-0)\} \frac{\sin(2N+1)u}{\sin u} du
\end{aligned}$$

ここで、 f は区分的に滑らかであり、 $u/\sin u \rightarrow 1$ ($u \rightarrow +0$) に注意すれば、 t を固定して区間 $(0, \omega T/4)$ で定義された u の関数

$$g_{\pm}(u) = \frac{f(t \pm 2u/\omega) - f(t \pm 0)}{\sin u} = \frac{f(t \pm 2u/\omega) - f(t \pm 0)}{\pm u} \frac{\pm u}{\sin u}$$

は有界で有限個の点を除いて連続である（可積分）。したがって、リーマン-ルベーグの定理を利用して

$$\lim_{N \rightarrow \infty} \int_0^{\omega T/4} g_{\pm}(u) \sin(2N+1)u du = 0$$

がわかる。したがって

$$\lim_{N \rightarrow \infty} \left| S_N(t) - \left[\frac{1}{2} \{f(t+0) + f(t-0)\} \right] \right| = 0$$

■

例 1.4: 方形波

$$f_4(t) = \begin{cases} -1 & (-T/2 < t < 0) \\ 1 & (0 < t < T/2) \end{cases}$$

$f_4(t)$ は奇関数で、フーリエ展開は

$$\begin{aligned}
f_4(t) &= \frac{4}{\pi} \sum_{n=0}^{\infty} \frac{\sin(2n+1)\omega t}{2n+1} \\
&= \frac{4}{\pi} \left(\sin \omega t + \frac{1}{3} \sin 3\omega t + \frac{1}{5} \sin 5\omega t + \cdots \right)
\end{aligned}$$

となる。この展開の部分 $S_N(t)$ をグラフにプロットすると図 1.1 のようになる。

不連続な点 $0, \pm\pi$ 以外では N が大きくなるとき $S_N(t)$ は $f_4(t)$ に収束することが観察できるが、 $T = 0, \pm\pi$ の近くでは $S_N(t)$ は強く振動し、 $f(t)$ よりも大きく飛び出した点が存在する。しかも N を大きくしてもこれは消えない。この現象をギブス現象という。また、連続な点でも小さな振動は消えない。電子工学では、この飛び出しをオーバーシュート、振動をリップル、リンキングなどと呼ぶ。この飛び出しの高さは、

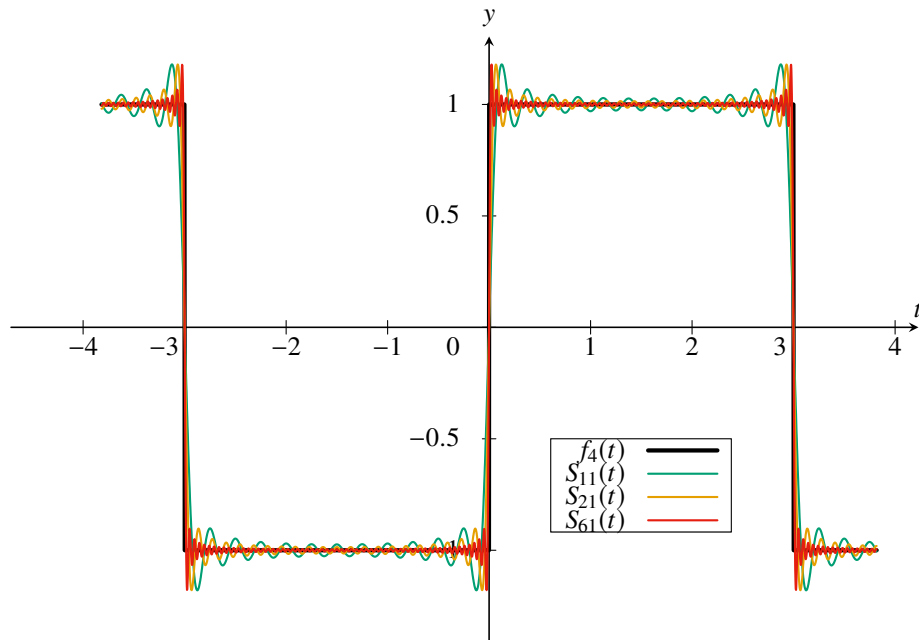


図 1.1 方形波とそのフーリエ部分和. ただし $T = 2\pi$, つまり $\omega = 1$.

$\Delta t = \omega t$, $(2N + 1)\Delta t = \pi$ とおくと

$$\begin{aligned} S_N(t) &= \frac{4}{\pi} \sum_{n=0}^N \frac{\sin(2n+1)\omega t}{2n+1} \\ &= \frac{4}{\pi} \sum_{n=0}^N \frac{\sin(2n+1)\Delta t}{(2n+1)\Delta t} \Delta t \\ &\xrightarrow{N \rightarrow \infty} \frac{2}{\pi} \int_0^\pi \frac{\sin t}{t} dt = 1.178978 \dots \end{aligned}$$

に収束することが示せる. このギブス現象は, どのような不連続点の周りでも発生する一般的な現象である. これを回避する方法として総和法がある. ■

■**総和法** $G(s)$ を $[-1, 1]$ に台をもつ有界関数で $G(0) = 1$ かつ $s = 0$ で連続であるとする. このとき, 重み関数 $G(s)$ に対応する部分和を

$$S_N^G(t) = \sum_{n=-N}^N G\left(\frac{n}{N}\right) c[n] e^{in\omega t} \quad (t \in \mathbb{R})$$

とおく. $G(s)$ が上の条件を満たせば, 形式的には

$$\lim_{N \rightarrow \infty} S_N^G(t) = \sum_{n=-\infty}^{\infty} c[n] e^{in\omega t} = f(t)$$

となり, 同じフーリエ展開を与えるはずである. しかし, 収束の性質は $G(s)$ の選び方によって異なってくる. このような手法を総和法という.

フェイエル和 (チェザロ和)

$$G(s) = \begin{cases} 1 - |s| & (s \in [-1, 1]) \\ 0 & (\text{otherwise}) \end{cases}$$

とおいたときの部分和

$$\sigma_N(t) = S_N^G(t) = \sum_{n=-N}^N \left(\frac{N - |n|}{N} \right) c[n] e^{in\omega t}$$

をフェイエル和という.

定理 1.14 f を連続な周期関数とすると, $\sigma_N(t)$ は $N \rightarrow \infty$ のとき f に一様収束する.

ハン窓 フーリエ級数の総和法はデジタル信号処理で実用的に大切な役割を果たす. この文脈では, 重み関数 $G(s)$ は窓関数とよばれる.

$$H(s) = \begin{cases} \frac{1}{2}(1 + \cos \pi s) & (s \in [-1, 1]) \\ 0 & (\text{otherwise}) \end{cases}$$

をハン窓という. 定理 1.14 同様に, 連続関数のフーリエ級数のハン窓による部分和は, もとの関数に一様収束する.