

Fizyka dla firm — Matematyka

27. Funkcje wielu zmiennych

P. F. Góra

https://zfs.fais.uj.edu.pl/pawel_gora

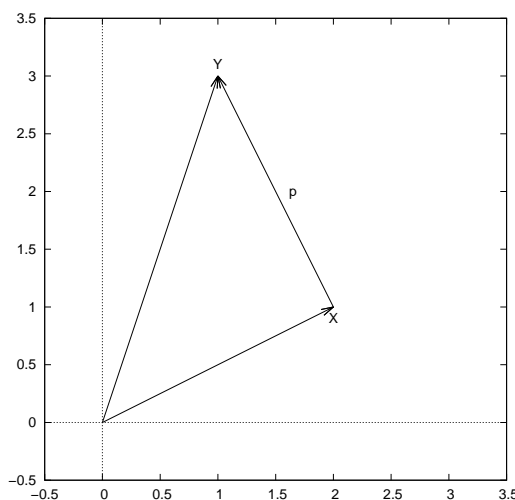
8 marca 2023

Dodawanie punktów i wektorów ☺

Punkt w przestrzeni $X \in \mathbb{R}^N$ można utożsamiać z jego wektorem wodzącym \vec{X} . Jeśli $\mathbf{p} \in \mathbb{R}^N$ jest wektorem, napis

$$\vec{Y} = \vec{X} + \mathbf{p} \quad (1)$$

będzie oznaczać *punkt* o wektorze wodzącym \vec{Y} .



Funkcje wielu zmiennych

Rozważamy przestrzeń \mathbb{R}^N zadaną metryką $\varrho(\cdot, \cdot)$. Nas będzie interesować wyłącznie metryka euklidesowa, ale w rozmaitych zastosowaniach bardziej użyteczne mogą okazać się inne metryki.

Funkcją rzeczywistą N zmiennych rzeczywistych nazywam **relację jednoznaczą** $f : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}$: Pewnemu punktowi przestrzeni \mathbb{R}^N — lub pewnemu zestawowi zmiennych x_1, x_2, \dots, x_N , będącymi współrzędnymi tego punktu — przyporządkowuję w sposób **jednoznaczny** pewną liczbę rzeczywistą, będącą wartością funkcji w tym punkcie.

Jednoznaczność ma zasadnicze znaczenie: temu samemu punktowi może być przypisana jedna i tylko jedna wartość funkcji, ale, w ogólności, wartość ta może być przypisana wielu punktom. Oczywiście *inne* funkcje mogą w tym punkcie przybierać inne wartości.

Przykład 1

Przykłady funkcji rzeczywistych dwu, trzech, czterech zmiennych rzeczywistych:

$$f_1(x, y) = x^2 + xy + y^2 \quad (2a)$$

$$f_2(x, y) = x \cdot \sin(y) - y \cdot \cos(x) \quad (2b)$$

$$f_3(x, y, z) = \frac{xy + xz + yz}{x^2 + y^2 + z^2} \quad (2c)$$

$$f_4(x_1, x_2, x_3, x_4) = \frac{\ln(4x_1^2 + 3x_2^2 + 2x_3^2 + x_4^2)}{x_1^2 + x_2^2 + x_3^2 + x_4^2} \quad (2d)$$

Zauważmy, że $f_1, f_2 : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$, $f_3 : \mathbb{R}^3 \rightarrow \mathbb{R}$, $f_4 : \mathbb{R}^4 \rightarrow \mathbb{R}$.

Granica funkcji wielu zmiennych

W przestrzeni metrycznej (\mathbb{R}^N, ρ) możemy zdefiniować granicę funkcji w punkcie, uogólniając znaną z teorii funkcji jednej zmiennej definicję Cauchy'ego:

$$\lim_{\mathbf{x} \rightarrow \mathbf{x}_0} f(\mathbf{x}) = g \Leftrightarrow \forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall \mathbf{x} : (\rho(\mathbf{x}, \mathbf{x}_0) < \delta \Rightarrow |f(\mathbf{x}) - g| < \varepsilon) \quad (3)$$

Można też sformułować równoważną definicję Heinego, wykorzystującą zbieżność ciągów:

$$\lim_{\mathbf{x} \rightarrow \mathbf{x}_0} f(\mathbf{x}) = g \Leftrightarrow \forall \{\mathbf{x}_n\}_{n=1}^{\infty} : \left(\lim_{n \rightarrow \infty} \mathbf{x}_n = \mathbf{x}_0 \Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} f(\mathbf{x}_n) = g \right) \quad (4)$$

Można także definiować granice niewłaściwe.

Uwaga!

Granica funkcji wielu zmiennych może nie istnieć, podobnie jak nie musi istnieć granica funkcji jednej zmiennej. W przypadku wielowymiarowym pojawia się jednak nowy problem, niewystępujący w przypadku jednowymiarowym: **Granica funkcji wielu zmiennych nie może zależeć od drogi, wzdłuż której zmierzamy**, czy też od sposobu, w jaki zmierzamy **do granicy**.

Przykład 2

Przyjrzyjmy się funkcji

$$f(x, y) = \frac{xy}{x^2 + y^2} \quad (5)$$

i rozpatrzmy granicę

$$\lim_{(x,y) \rightarrow (0,0)} \frac{xy}{x^2 + y^2} \quad (6)$$

1. Niech $y = x$. Wówczas granica (6) przybiera postać

$$\lim_{x \rightarrow 0} \frac{x^2}{x^2 + x^2} = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{1}{2} = \frac{1}{2} \quad (7a)$$

2. Niech $y = \sqrt{|x|}$. W tym wypadku otrzymujemy

$$\lim_{x \rightarrow 0} \frac{x\sqrt{|x|}}{x^2 + |x|} = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{(\operatorname{sgn}(x))\sqrt{|x|}}{x \operatorname{sgn}(x) + 1} = 0 \quad (7b)$$

3. Niech teraz $x = r \cos \varphi$, $y = r \sin \varphi$. W tym wypadku otrzymujemy

$$\lim_{r \rightarrow 0^+} \frac{r^2 \sin \varphi \cos \varphi}{r^2 \cos^2 \varphi + r^2 \sin^2 \varphi} = \frac{1}{2} \sin(2\varphi) \quad (7c)$$

Jak widzimy, granica (6) przybiera różne wartości w zależności od sposobu podążania do punktu $(0, 0)$. Wnioskujemy stąd, że granica (6) nie istnieje.

Granice iterowane

Jeżeli granica (3) istnieje, istnieją też **granice iterowane**, czyli granice, gdy poszczególne zmienne “po kolei” zbiegają do punktu granicznego.

Dla przykładu funkcji dwóch zmiennych

$$\begin{aligned} \lim_{(x,y) \rightarrow (x_0,y_0)} f(x,y) = g &\Rightarrow \lim_{x \rightarrow x_0} \left(\lim_{y \rightarrow y_0} f(x,y) \right) = g \\ &\wedge \lim_{y \rightarrow y_0} \left(\lim_{x \rightarrow x_0} f(x,y) \right) = g \end{aligned} \quad (8)$$

Istnienie i równość granic iterowanych jest warunkiem koniecznym istnienia granicy, ale **nie** jest warunkiem wystarczającym.

Przykład 3

Po raz kolejny rozpatrzmy funkcję (5). Granice iterowane spełniają

$$\lim_{x \rightarrow 0} \left(\lim_{y \rightarrow 0} \frac{xy}{x^2 + y^2} \right) = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{x \cdot 0}{x^2 + 0^2} = \lim_{x \rightarrow 0} 0 = 0 \quad (9a)$$

$$\lim_{y \rightarrow 0} \left(\lim_{x \rightarrow 0} \frac{xy}{x^2 + y^2} \right) = \lim_{y \rightarrow 0} \frac{0 \cdot y}{0^2 + y^2} = \lim_{y \rightarrow 0} 0 = 0 \quad (9b)$$

a jednak granica (6) nie istnieje.

Granic iterowanych często używa się do wykazania, że jakaś granica funkcji wielu zmiennych *nie* istnieje: Gdyby granica istniała, granice iterowane musiałyby być równe. Jeśli granice iterowane różnią się od siebie, granica nie istnieje. Rozważmy

Przykład 4

Niech

$$g(x, y) = \frac{x^2 - y^2}{x^2 + y^2} \quad (10)$$

Czy granica

$$\lim_{(x,y) \rightarrow (0,0)} g(x, y) \quad (11)$$

istnieje?

Rozważam granice iterowane:

$$\lim_{x \rightarrow 0} \left(\lim_{y \rightarrow 0} \frac{x^2 - y^2}{x^2 + y^2} \right) = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{x^2}{x^2} = 1 \quad (12a)$$

$$\lim_{y \rightarrow 0} \left(\lim_{x \rightarrow 0} \frac{x^2 - y^2}{x^2 + y^2} \right) = \lim_{y \rightarrow 0} \frac{-y^2}{y^2} = -1 \quad (12b)$$

Ponieważ granice (12a), (12b) różnią się od siebie, wnioskujemy, że granica (11) nie istnieje.

Zdefiniowawszy pojęcie granicy w przestrzeni \mathbb{R}^N , możemy teraz zdefiniować ciągłość funkcji, pojęcie ciągu Cauchy'ego, a także zastanowić się, w jaki sposób można uogólnić pojęcie pochodnej. Dla funkcji jednej zmiennej x pochodna określa prędkość zmian, gdy wartość zmiennej niezależnej zmienia się o infinitesimalnie małą wielkość. W przypadku funkcji wielu zmiennych każda z nich może się zmieniać niezależnie od pozostałych.

Pochodna kierunkowa

Niech $f : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}$ będzie pewną funkcją, $\mathbf{x}_0 \in \mathbb{R}^N$ pewnym punktem, $\mathbf{p} \in \mathbb{R}^N$ — pewnym wektorem unormowanym do jedności, $\|\mathbf{p}\| = 1$. Zdefiniujmy

$$g(\alpha) = f(\mathbf{x}_0 + \alpha\mathbf{p}) \quad (13)$$

Zauważmy, że funkcja (13) *jest funkcją jednej zmiennej, α* . Możemy zatem rozważać jej pochodną

$$\left. \frac{dg}{d\alpha} \right|_{\alpha=0} = \left(\left. \frac{d}{d\alpha} f(\mathbf{x}_0 + \alpha\mathbf{p}) \right) \right|_{\alpha=0} \quad (14)$$

Jeżeli pochodna (14) istnieje, nazywam ją **pochodną kierunkową funkcji f** w punkcie \mathbf{x}_0 w kierunku wektora \mathbf{p} .

Przykład 5

$$f(x, y) = (x + y)^2 \cdot \sin(x - y) \quad (15)$$

Niech $\mathbf{x}_0 = \left(\frac{\pi}{2}, \frac{\pi}{2}\right)$, $\mathbf{p} = \left[\frac{1}{\sqrt{2}}, \frac{1}{\sqrt{2}}\right]$. Wówczas funkcja (13) przybiera postać

$$\begin{aligned} g(\alpha) &= \left(\frac{\pi}{2} + \frac{\alpha}{\sqrt{2}} + \frac{\pi}{2} + \frac{\alpha}{\sqrt{2}}\right)^2 \sin\left(\frac{\pi}{2} + \frac{\alpha}{\sqrt{2}} - \frac{\pi}{2} - \frac{\alpha}{\sqrt{2}}\right) \\ &= \left(\pi + \sqrt{2}\alpha\right)^2 \cdot \sin 0 = 0 \end{aligned} \quad (16)$$

$\frac{dD}{d\alpha} = 0$ i widzimy, że pochodna kierunkowa funkcji (15) w podanym punkcie i w kierunku podanego wektora wynosi 0.

Przykład 6

Niech $f(x, y)$ będzie określona wzorem (15), $\mathbf{x}_0 = \left(\frac{\pi}{2}, \frac{\pi}{2}\right)$ jak poprzednio, ale $\mathbf{p} = \left[\frac{1}{\sqrt{2}}, -\frac{1}{\sqrt{2}}\right]$. Wówczas funkcja (13) przybiera postać

$$\begin{aligned} g(\alpha) &= \left(\frac{\pi}{2} + \frac{\alpha}{\sqrt{2}} - \frac{\pi}{2} + \frac{\alpha}{\sqrt{2}}\right)^2 \sin\left(\frac{\pi}{2} + \frac{\alpha}{\sqrt{2}} - \frac{\pi}{2} + \frac{\alpha}{\sqrt{2}}\right) \\ &= \pi^2 \cdot \sin(\sqrt{2}\alpha) \end{aligned} \quad (17)$$

Zatem pochodna kierunkowa funkcji (15) w tym samym punkcie, co poprzednio, ale w kierunku drugiego podanego wektora wynosi

$$\begin{aligned} \frac{dg}{d\alpha}\Big|_{\alpha=0} &= \frac{d}{d\alpha} \pi^2 \cdot \sin(\sqrt{2}\alpha)\Big|_{\alpha=0} \\ &= \pi^2 \sqrt{2} \cos(\sqrt{2}\alpha)\Big|_{\alpha=0} = \sqrt{2} \pi^2 \end{aligned} \quad (18)$$

Przykład 7

$$f(x, y) = xy, \quad \frac{\partial f}{\partial x} = y, \quad \frac{\partial f}{\partial y} = x \quad (20a)$$

$$f(x, y) = \frac{x + y}{x^2 + y^2}, \quad \frac{\partial f}{\partial x} = \frac{-x^2 + y^2 - 2xy}{(x^2 + y^2)^2}, \quad \frac{\partial f}{\partial y} = \frac{x^2 - y^2 - 2xy}{(x^2 + y^2)^2} \quad (20b)$$

$$f(x, y) = \sin(2x + 3y), \quad \frac{\partial f}{\partial x} = 2 \cos(2x + 3y), \quad \frac{\partial f}{\partial y} = 3 \cos(2x + 3y) \quad (20c)$$

Przykład 8

Pochodne cząstkowe funkcji (15) wynoszą

$$\frac{\partial f}{\partial x} = 2(x + y) \cdot \sin(x - y) + (x + y)^2 \cos(x - y) \quad (21a)$$

$$\frac{\partial f}{\partial y} = 2(x + y) \cdot \sin(x - y) - (x + y)^2 \cos(x - y) \quad (21b)$$

Pochodna zupełna

Dla uproszczenia notacji ograniczę się tu do funkcji dwu zmiennych, ale wynik można łatwo uogólnić na przypadki więcejwymiarowe.

Niech $f(u, v)$ będzie różniczkowalną funkcją dwu zmiennych. Załóżmy teraz, że $u = u(t), v = v(t)$ same są funkcjami jakiejś innej zmiennej, t . Wówczas

$$z(t) = f(u(t), v(t)) \quad (22)$$

Jak obliczyć pochodną $z(t)$? Jeśli znamy *jawną* postać funkcji f , możemy podstawić i różniczkować jak w przypadku jednowymiarowym. Okazuje się jednak, że — uogólniając pojęcie pochodnej funkcji złożonej — można pokazać, że

$$\frac{dz}{dt} = \frac{\partial f}{\partial u} \cdot \frac{du}{dt} + \frac{\partial f}{\partial v} \cdot \frac{dv}{dt} \quad (23)$$

lub, uogólniając na N zmiennych,

$$\frac{dz}{dt} = \frac{\partial f}{\partial x_1} \cdot \frac{dx_1}{dt} + \frac{\partial f}{\partial x_2} \cdot \frac{dx_2}{dt} + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_N} \cdot \frac{dx_N}{dt}. \quad (24)$$

Wzór (24) nazywa się wzorem na **pochoďną zupełną** lub **całkowitą**.

Przykład 9

Rozpatrzmy funkcję (15) zakładając, że x, y zależą od zmiennej t w ten sposób: $x = at, y = bt$. Niech $z(t) = f(at, bt)$. Korzystając ze wzoru na pochodną zupełną i obliczonych wcześniej pochodnych cząstkowych, mamy

$$\begin{aligned}\frac{dz}{dt} &= \frac{\partial f}{\partial x} \cdot \frac{dx}{dt} + \frac{\partial f}{\partial y} \cdot \frac{dy}{dt} \\ &= \left(2(at + bt) \cdot \sin(at - bt) + (at + bt)^2 \cos(at - bt)\right) \cdot a \\ &+ \left(2(at + bt) \cdot \sin(at - bt) - (at + bt)^2 \cos(at - bt)\right) \cdot b \\ &= 2(a + b)^2 t \sin((a - b)t) + (a - b)(a + b)^2 t^2 \cos((a - b)t)\end{aligned}\tag{25}$$

Gradient funkcji

Wektor złożony z pochodnych cząstkowych (ze *wszystkich* pochodnych cząstkowych) pewnej funkcji w danym punkcie nazywam **gradientem funkcji** i oznaczam

$$\left[\frac{\partial f}{\partial x_1}, \frac{\partial f}{\partial x_2}, \frac{\partial f}{\partial x_3}, \dots \right] = \text{grad } f = \nabla f \quad (26)$$

gdzie symbol ∇ , “nabla”, oznacza formalny operator różniczkowania po kolejnych współrzędnych:

$$\nabla = \left[\frac{\partial}{\partial x_1}, \frac{\partial}{\partial x_2}, \frac{\partial}{\partial x_3}, \dots \right] \quad (27)$$

Geometryczna interpretacja gradientu

Niech $f : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}$ będzie pewną funkcją (co najmniej) jednokrotnie różniczkowalną w sposób ciągły. Przypuśćmy, że znajdujemy się w punkcie \mathbf{x} i przesuwamy się o niewielką wartość α , $|\alpha| \ll 1$, w kierunku pewnego wektora \mathbf{p} :

$$\mathbf{x} \rightarrow \mathbf{x} + \alpha \mathbf{p}. \quad (28)$$

Pytanie, jak bardzo na skutek tego przesunięcia zmieni się wartość funkcji f ?

Zauważmy, że funkcja

$$g(\alpha) = f(\mathbf{x} + \alpha \mathbf{p}) \quad (29)$$

podobnie jak wcześniej, jest, przy ustalonych wartościach \mathbf{x} i \mathbf{p} , *funkcją jednej zmiennej*, α . Rozwijając ją w szereg Taylora do pierwszego rzędu dostajemy

$$g(\alpha) \simeq g(0) + \alpha \left. \frac{dg}{d\alpha} \right|_{\alpha=0} \quad (30a)$$

$$\Delta f \equiv \Delta g = g(\alpha) - g(0) \simeq \alpha \left. \frac{dg}{d\alpha} \right|_{\alpha=0} \quad (30b)$$

gdzie “ Δf ” oznacza zmianę funkcji f .

Możemy napisać

$$g(\alpha) = f(\mathbf{x} + \alpha \mathbf{p}) = f(x_1 + \alpha p_1, x_2 + \alpha p_2, \dots, x_N + \alpha p_N) \quad (31)$$

zatem, zgodnie ze wzorem na pochodną zupełną (24),

$$\begin{aligned} \left. \frac{dg}{d\alpha} \right|_{\alpha=0} &= \left. \sum_{i=1}^N \left(\frac{\partial f(\mathbf{x} + \alpha \mathbf{p})}{\partial (x_i + \alpha p_i)} \cdot \frac{d(x_i + \alpha p_i)}{d\alpha} \right) \right|_{\alpha=0} \\ &= \sum_{i=1}^N \frac{\partial f}{\partial x_i} p_i = (\nabla f) \circ \mathbf{p} \end{aligned} \quad (32)$$

gdzie p_i są składowymi wektora \mathbf{p} . Innymi słowy,

$$\Delta f \simeq \alpha \cdot (\nabla f) \circ \mathbf{p} \quad (33)$$

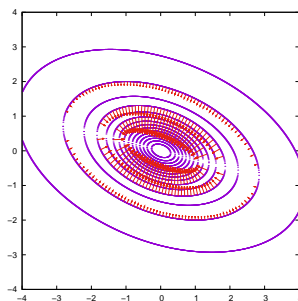
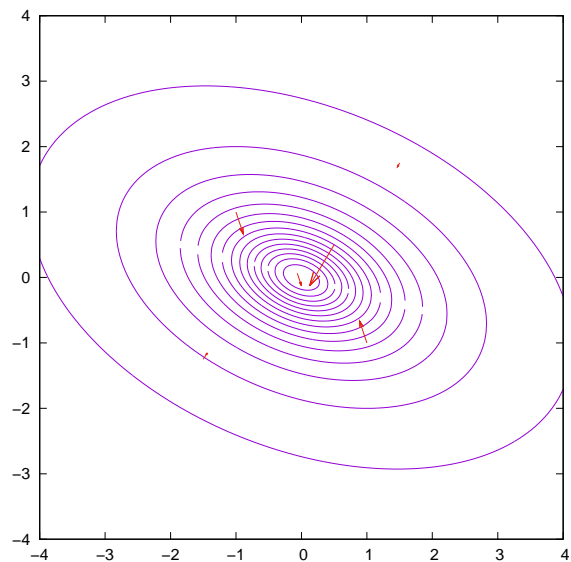
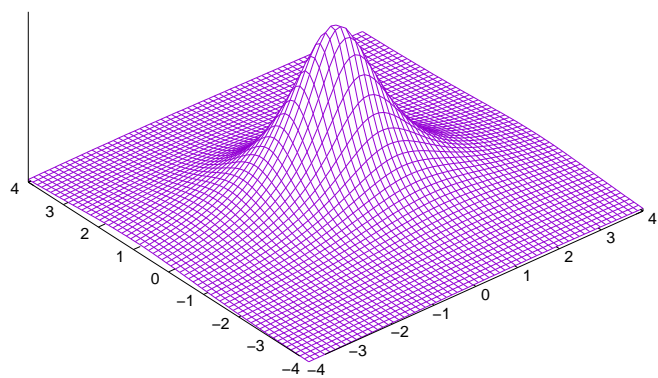
Zatem przy ustalonych wartościach α , $\|\mathbf{p}\|$, zmiana funkcji (33) jest największa, gdy $\angle(\nabla f, \mathbf{p}) = 0$. **Gradient wskazuje kierunek najszybszego wzrostu wartości funkcji.**

Poziomnice

Poziomnice to krzywe, wzdłuż których wartość funkcji wielu zmiennych jest stała.

Z wyrażenia (33) wynika, że jeżeli $(\nabla f) \circ \mathbf{p} = 0$, czyli gdy kierunek gradientu i kierunek lokalnego przesunięcia są prostopadłe, $\Delta f = 0$: Bardzo małe ($|\alpha| \ll 1$) przesunięcie w kierunku prostopadłym do gradientu nie prowadzi do zmiany wartości funkcji. Wynika stąd, że gradient jest (lokalnie) prostopadły do poziomnic funkcji.

Przykład 10



Pochodne cząstkowe wyższych rzędów

Pochodne cząstkowe funkcji N zmiennych same są funkcjami N zmiennych. Można więc definiować *ich* pochodne cząstkowe, czyli pochodne pochodnych. Zmienne mogą się mieszać! Dla funkcji dwóch zmiennych $f(x, y)$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x^2} = \frac{\partial}{\partial x} \left(\frac{\partial f}{\partial x} \right) \quad (34a)$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y} = \frac{\partial}{\partial x} \left(\frac{\partial f}{\partial y} \right) \quad (34b)$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x} = \frac{\partial}{\partial y} \left(\frac{\partial f}{\partial x} \right) \quad (34c)$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial y^2} = \frac{\partial}{\partial y} \left(\frac{\partial f}{\partial y} \right) \quad (34d)$$

W sposób oczywisty można to uogólnić na funkcje trzech i więcej zmiennych, a także na pochodne wyższych rzędów.

Przykład 11

Niech

$$f(x, y) = \frac{x - y}{x + y} \quad (35a)$$

Wówczas

$$\frac{\partial f}{\partial x} = \frac{2y}{(x+y)^2} \quad (35b)$$

$$\frac{\partial f}{\partial y} = \frac{-2x}{(x+y)^2} \quad (35c)$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x^2} = \frac{-4y}{(x+y)^3} \quad (35d)$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y} = \frac{2(x-y)}{(x+y)^3} \quad (35e)$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x} = \frac{2(x-y)}{(x+y)^3} \quad (35f)$$

$$\frac{\partial^2 f}{\partial y^2} = \frac{4x}{(x+y)^3} \quad (35g)$$

Funkcje klasy C_2

Jeżeli funkcja dwu zmiennych jest odpowiednio gładka, to

1° jej drugie pochodne cząstkowe są ciągłe

2° pochodne mieszane są sobie równe

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y} = \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x} \quad (36)$$

i podobnie dla większej liczby zmiennych:

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j} = \frac{\partial^2 f}{\partial x_j \partial x_i}, \quad i, j = 1, \dots, N \quad (37)$$

O funkcjach, których drugie pochodne są ciągłe i które spełniają warunek (37) mówimy, że są **klasy C_2** .

W ogólności funkcja N zmiennych ma N^2 drugich pochodnych cząstkowych. Jeżeli funkcja jest klasy co najmniej C_2 , liczba *niezależnych* drugich pochodnych cząstkowych redukuje się do $N(N - 1)/2$.

Różniczka zupełna

Niech $f : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}$ będzie funkcją klasy (co najmniej) C_2 . Wyrażenie

$$df = \frac{\partial f}{\partial x_1} \cdot dx_1 + \frac{\partial f}{\partial x_2} \cdot dx_2 + \cdots + \frac{\partial f}{\partial x_N} \cdot dx_N \quad (38)$$

nazywam **różniczką zupełną** funkcji f w pewnym punkcie, mianowicie w tym, w którym obliczane są wszystkie pochodne cząstkowe. Różniczka zupełna opisuje zmianę funkcji, gdy poszczególne zmienne *niezależnie* zmieniają się o infinytesymalnie małe wielkości, odpowiednio, dx_1, dx_2, \dots, dx_N .

Zauważmy, że ponieważ df jest różniczką funkcji klasy C_2 , pochodne mieszane z założenia są sobie równe.

Różniczka zupełna określa geometrię hiperpłaszczyzny lokalnie stycznej do N wymiarowego “wykresu” funkcji f .