

AM2: Tracce delle lezioni- VII Settimana

Cammini differenziabili.

Se $\gamma(t) = (x_1(t), \dots, x_n(t))$, $x_i \in C^1([0, 1]) \forall i = 1, \dots, n$ scriveremo $\gamma \in C^1([0, 1], \mathbf{R}^n)$ e diremo che γ é cammino differenziabile e

$$\dot{\gamma}(t) = (\dot{x}_1(t), \dots, \dot{x}_n(t)) \quad \text{é il} \quad \mathbf{vettore tangente} \quad \text{a } \gamma \text{ in } \gamma(t).$$

Esempio. $\gamma(t) = (r \cos 2\pi t, r \sin 2\pi t)$, $t \in [0, 1]$, $\dot{\gamma}(t) = (-2\pi r \sin 2\pi t, 2\pi r \cos 2\pi t)$

Sia $f \in C^1(\mathbf{R}^2)$, $h \in \mathbf{R}^2$. Sia $\gamma(t) = (th, f(th))$ parametrizzazione della curva ottenuta intersecando il grafico di f con il piano passante per l'asse delle z e per la retta che unisce h all'origine. Il vettore tangente alla curva γ in $(0, 0, f(0, 0))$ é

$$(h, \langle \nabla f(0, 0), h \rangle) = \left(\frac{d}{dt}(th), \frac{d}{dt}f(th) \right)_{|_{t=0}}$$

Al variare di h in \mathbf{R}^2 si ottengono tutti i **vettori tangenti al grafico di f** in $(0, 0)$. Questi sono tutti e soli i punti del piano in \mathbf{R}^3 di equazione

$$x_3 = f(0, 0) + \frac{\partial f}{\partial x_1}(0, 0)x_1 + \frac{\partial f}{\partial x_2}(0, 0)x_2$$

Tale piano approssima il grafico di f a meno di errori di ordine superiore al primo (piano tangente).

Derivazione lungo un cammino (derivazione di funzioni composte)

Sia $f \in C^1(O)$, $\gamma \in C^1([0, 1], O)$ Allora

$$\frac{d}{dt}f(\gamma(t)) = \langle \nabla f(\gamma(t)), \dot{\gamma}(t) \rangle$$

É: $\gamma(t+s) = \gamma(t) + \dot{\gamma}(t)s + h(s)$, $f(u+h) = f(u) + \langle \nabla f(u), h \rangle + \sigma(h) \Rightarrow$

$$f(\gamma(t+s)) = f(\gamma(t)) + \langle \nabla f(\gamma(t)), \dot{\gamma}(t) \rangle s + \sigma(s) \quad \text{ove}$$

$\sigma(s) := \langle \nabla f(\gamma(t)), h(s) \rangle + \sigma(\dot{\gamma}(t)s + h(s))$. Infatti $\forall \epsilon > 0, \exists \delta_\epsilon > 0, s_\epsilon > 0 :$

$(\|k\| \leq \delta_\epsilon \Rightarrow \sigma(k) \leq \epsilon \|k\|)$ e $(|s| \leq s_\epsilon \Rightarrow \|h(s)\| \leq \epsilon |s|$ e $\|\dot{\gamma}(t)\| |s| + \|h(s)\| \leq \delta_\epsilon$)

$\Rightarrow |\langle \nabla f(\gamma(t)), h(s) \rangle + \sigma(\dot{\gamma}(t)s + h(s))| \leq \epsilon |s| (\|\nabla f(\gamma(t))\| + \|\dot{\gamma}(t)\| + 1)$.

DERIVATE SUCCESSIVE

Sia $f \in C^1(O)$, $O \subset \mathbf{R}^n$ aperto. Se f_{x_j} sono a loro volta derivabili, allora

$$f_{x_i x_j} = \frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j} := \frac{\partial}{\partial x_i} \frac{\partial f}{\partial x_j}, \quad i, j = 1, \dots, n$$

sono le derivate seconde.

Se $f_{x_i x_j} \in C(O)$, $\forall i, j = 1, \dots, n$, f si dice di classe $C^2(O)$.

LEMMA DI SCHWARTZ

$$f \in C^2(O) \quad \Rightarrow \quad \frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j} := \frac{\partial^2 f}{\partial x_j \partial x_i} \quad \forall i, j = 1, \dots, n$$

Prova. Sia, per semplicità, $n = 2$. Sia $R_\delta := [\bar{x} - \delta, \bar{x} + \delta] \times [\bar{y} - \delta, \bar{y} + \delta]$, $\delta \ll r$, $D_r(\bar{x}, \bar{y}) \subset O$. Si ha:

$$\begin{aligned} I_\delta &:= \frac{1}{4\delta^2} \int_{\bar{x}-\delta}^{\bar{x}+\delta} \left(\int_{\bar{y}-\delta}^{\bar{y}+\delta} \frac{\partial}{\partial y} \frac{\partial f}{\partial x}(x, y) dy \right) dx = \frac{1}{4\delta^2} \int_{\bar{x}-\delta}^{\bar{x}+\delta} \left[\frac{\partial f}{\partial x}(x, \bar{y} + \delta) - \frac{\partial f}{\partial x}(x, \bar{y} - \delta) \right] dx = \\ &= \frac{1}{4\delta^2} [f(\bar{x} + \delta, \bar{y} + \delta) - f(\bar{x} - \delta, \bar{y} + \delta) - f(\bar{x} + \delta, \bar{y} - \delta) + f(\bar{x} - \delta, \bar{y} - \delta)] = \\ &= \frac{1}{4\delta^2} \int_{\bar{y}-\delta}^{\bar{y}+\delta} \left[\frac{\partial f}{\partial y}(\bar{x} + \delta, y) - \frac{\partial f}{\partial y}(\bar{x} - \delta, y) \right] dy = \frac{1}{4\delta^2} \int_{\bar{y}-\delta}^{\bar{y}+\delta} \left(\int_{\bar{x}-\delta}^{\bar{x}+\delta} \frac{\partial}{\partial x} \frac{\partial f}{\partial y}(x, y) dx \right) dy \end{aligned}$$

Siccome $x \rightarrow \left(\int_{\bar{y}-\delta}^{\bar{y}+\delta} \frac{\partial}{\partial y} \frac{\partial f}{\partial x}(x, y) dy \right) dx$ è continua, per il teorema della media esiste $x_\delta \in [\bar{x} - \delta, \bar{x} + \delta]$ tale che $\int_{\bar{x}-\delta}^{\bar{x}+\delta} \left(\int_{\bar{y}-\delta}^{\bar{y}+\delta} \frac{\partial}{\partial y} \frac{\partial f}{\partial x}(x, y) dy \right) dx = 2\delta \left(\int_{\bar{y}-\delta}^{\bar{y}+\delta} \frac{\partial}{\partial y} \frac{\partial f}{\partial x}(x_\delta, y) dy \right)$. Con un'altra applicazione del teorema della media, e mandando δ a zero, otteniamo

$$\exists (x_\delta, y_\delta) \in R_\delta : I_\delta = \frac{1}{4\delta^2} \int_{\bar{x}-\delta}^{\bar{x}+\delta} \left(\int_{\bar{y}-\delta}^{\bar{y}+\delta} \frac{\partial}{\partial y} \frac{\partial f}{\partial x}(x, y) dy \right) dx = \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}(x_\delta, y_\delta) \rightarrow_\delta f_{yx}(\bar{x}, \bar{y})$$

e analogamente

$$\exists (x^\delta, y^\delta) \in R_\delta : I_\delta = \frac{1}{4\delta^2} \int_{\bar{y}-\delta}^{\bar{y}+\delta} \left(\int_{\bar{x}-\delta}^{\bar{x}+\delta} \frac{\partial}{\partial x} \frac{\partial f}{\partial y}(x, y) dx \right) dy = \frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}(x^\delta, y^\delta) \rightarrow_\delta f_{xy}(\bar{x}, \bar{y}).$$

MATRICE HESSIANA

Sia $f \in C^2(O)$ ed indichiamo con $u = (x_1, \dots, x_n)$ i punti di \mathbf{R}^n . La matrice $n \times n$ delle derivate seconde

$$H_f(u) := \left(\frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j}(u) \right)_{i,j=1,\dots,n}$$

é detta matrice Hessiana. Dal Lemma di Schwartz: H_f é **matrice simmetrica**.

FORMULA DI TAYLOR (al secondo ordine)

Sia $f \in C^2(D_r(u))$. Allora:

$$f(u+h) = f(u) + \langle \nabla f(u), h \rangle + \frac{1}{2} \langle H_f(u) h, h \rangle + o(\|h\|^2)$$

Prova. Sia $u = (x_1, \dots, x_n)$, $h = (h_1, \dots, h_n)$. Posto $\varphi(t) := f(u+th)$, é

$$\varphi(0) = f(u), \quad \varphi(1) = f(u+th)$$

$$\frac{d\varphi}{dt}(u+th) = \sum_{j=1}^n \frac{\partial f}{\partial x_j}(u+th) h_j$$

$$\begin{aligned} \frac{d^2\varphi}{dt^2}(u+th) &= \sum_{j=1}^n \frac{d}{dt} \frac{\partial f}{\partial x_j}(u+th) h_j = \sum_{j=1}^n \sum_{i=1}^n \frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j}(u+th) h_i h_j = \\ &= \langle H_f(u+th) h, h \rangle \end{aligned}$$

Ma $\varphi(1) = \varphi(0) + \varphi'(0) + \int_0^1 (1-t)\varphi''(t) dt$ e quindi

$$\begin{aligned} f(u+h) &= f(u) + \langle \nabla f(u), h \rangle + \frac{1}{2} \langle H_f(u) h, h \rangle + \\ &\quad \int_0^1 (1-t) \langle [H_f(u+th) - H_f(u)] h, h \rangle dt. \end{aligned}$$

La stima del resto segue da

$$\forall \epsilon > 0 \exists \delta_\epsilon > 0 : |t| \leq \delta_\epsilon \Rightarrow |f_{x_i x_j}(u+th) - f_{x_i x_j}(u)| \leq \epsilon \Rightarrow$$

$$\left| \sum_{i,j=1}^n [f_{x_i x_j}(u+th) - f_{x_i x_j}(u)] h_i h_j \right| \leq n^2 \epsilon \|h\|^2$$

MASSIMI E MINIMI IN PIÙ VARIABILI

$u \in \mathbf{R}^n$ é **minimo locale libero** per $f \Leftrightarrow \exists \delta > 0 : f(u) \leq f(v) \quad \forall v \in D_\delta(u)$

Condizioni necessarie. Se $u \in \mathbf{R}^n$ é **minimo locale libero** per f , allora

(i) $f \in C^1(D_r(u)) \Rightarrow \nabla f(u) = 0$ (u é **critico** o **stazionario** per f)

(ii) $f \in C^2(D_r(u)) \Rightarrow \langle H_f(u) h, h \rangle \geq 0 \quad \forall h \in \mathbf{R}^n$

Prova. (i) $h \in \mathbf{R}^n, |t| \leq \delta_h \Rightarrow f(u) \leq f(u + th) \Rightarrow$

$$0 = \frac{d}{dt} f(u + th)|_{t=0} = \langle \nabla f(u), h \rangle \Rightarrow \nabla f(u) = 0.$$

(ii) Dalla formula di Taylor: $\nabla f(u) = 0, \quad 0 \leq f(u + h) - f(u) =$

$$\nabla f(u) + \|h\|^2 \left[\langle H_f(u) \frac{h}{\|h\|}, \frac{h}{\|h\|} \rangle + o(1) \right] \Rightarrow \langle H_f(u) \frac{h}{\|h\|}, \frac{h}{\|h\|} \rangle \geq 0$$

Una condizioni sufficiente. Sia $f \in C^2(D_r(u))$, e $\nabla f(u) = 0$:

$$\langle H_f(u) h, h \rangle > 0 \quad \forall h \in \mathbf{R}^n, h \neq 0, \Rightarrow u \text{ é minimo locale}$$

Prova. $h \rightarrow \langle H_f(u) h, h \rangle$ continua, $\langle H_f(u) h, h \rangle > 0 \quad \forall h \in \mathbf{R}^n, h \neq 0, \Rightarrow$

$$\exists m := \min_{\|h\|=1} \langle H_f(u) h, h \rangle > 0$$

Quindi, $\langle H_f(u) h, h \rangle \geq m \|h\|^2 \quad \forall h \in \mathbf{R}^n$. Allora, usando Taylor e $\nabla f(u) = 0$ vediamo che $0 < \|h\| \ll 1 \Rightarrow$

$$f(u + h) - f(u) = \|h\|^2 \left[\langle H_f(u) \frac{h}{\|h\|}, \frac{h}{\|h\|} \rangle + o(1) \right] \geq \|h\|^2 [m + o(1)] > 0$$

Massimi locali liberi Se invece $\exists \delta > 0 : f(u) \geq f(v) \quad \forall v \in D_\delta(u)$, u si dice massimo locale libero per f . Anche in tal caso, se $f \in C^1(D_r(u))$, necessariamente $\nabla f(u) = 0$, mentre, se $f \in C^2(D_r(u))$, allora $\langle H_f(u) h, h \rangle \leq 0 \quad \forall h \in \mathbf{R}^n$.

Analogamente, la condizione sufficiente perché u sia massimo locale libero per $f \in C^2(D_r(u))$ é che

$$\nabla f(u) = 0 \quad \text{e} \quad \langle H_f(u) h, h \rangle < 0 \quad \forall h \in \mathbf{R}^n, h \neq 0$$

Forme quadratiche

La natura di un punto stazionario $u = (x_1, \dots, x_n)$ di f dipende dalle proprietà di segno della forma quadratica associata alla matrice Hessiana

$$\langle H_f(u) h, h \rangle = \sum_{i,j=1}^n \frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j}(u) h_i h_j = \quad h = (h_1, \dots, h_n)$$

Ora, $H_f(u)$ simmetrica $\Rightarrow H_f(u)$ ha autovalori reali, diciamo $\lambda_1 \leq \dots \leq \lambda_n$. Le proprietà di segno della forma quadratica associata sono legate al segno degli autovalori. Diamo qui una dimostrazione analitica di questo fatto.

Sia $\mathcal{A} = (a_{ij})_{i,j=1,\dots,n} = \mathcal{A}^t$ matrice $n \times n$ simmetrica. La forma quadratica associata

$$\langle \mathcal{A} h, h \rangle := \sum_{i,j=1}^n a_{ij} h_i h_j, \quad h = (h_1, \dots, h_n) \in \mathbf{R}^n \quad \text{si dice}$$

definita positiva (negativa) se $\langle \mathcal{A} h, h \rangle > 0 (< 0), \forall h \neq (0, 0)$

semidefinita positiva (negativa) se $\langle \mathcal{A} h, h \rangle \geq 0 (\leq 0), \forall h \in \mathbf{R}^n$

Proposizione Sia $\mathcal{A} = (a_{ij})$ matrice simmetrica $n \times n$, $\lambda_1 \leq \dots \leq \lambda_n$ i suoi autovalori. Allora

$$\lambda_1 = \inf_{\|h\|=1} \langle \mathcal{A} h, h \rangle \quad \lambda_n = \sup_{\|h\|=1} \langle \mathcal{A} h, h \rangle$$

Prova. Sia $m := \langle \mathcal{A} \bar{h}, \bar{h} \rangle = \min_{\|h\|=1} \langle \mathcal{A} h, h \rangle = \min_{\|h\| \neq 0} \frac{\langle \mathcal{A} h, h \rangle}{\|h\|^2}$. Siccome $\nabla \langle \mathcal{A} h, h \rangle = 2\mathcal{A}h$ e $\nabla \|h\|^{-2} = 2 \frac{h}{\|h\|^4}$ e quindi

$$\nabla \frac{\langle \mathcal{A} h, h \rangle}{\|h\|^2} = 2 \frac{\mathcal{A}h}{\|h\|^2} - 2 \langle \mathcal{A} h, h \rangle \frac{h}{\|h\|^4} = 0$$

se $h = \bar{h}$ e quindi $\mathcal{A} \bar{h} = \langle \mathcal{A} \bar{h}, \bar{h} \rangle \bar{h} = m \bar{h}$

Dunque m è un autovalore di \mathcal{A} , necessariamente il più piccolo, giacché $\mathcal{A}h = \lambda h, \|h\| = 1 \Rightarrow \lambda = \langle \mathcal{A} h, h \rangle \geq m$.

Corollario

(ii) \mathcal{A} è definita positiva (negativa) $\Leftrightarrow \lambda_1 > 0$ ($\lambda_n < 0$)

(iii) \mathcal{A} è semidefinita positiva (negativa) $\Leftrightarrow \lambda_1 = 0$ ($\lambda_n = 0$)

ESEMPLI. 1. Sia $f(x, y) = (x^2 + y^2)^2 - 2(x^2 - y^2)$
 È $f_x = 4x(x^2 + y^2) - 4x$, $f_y = 4y(x^2 + y^2) + 4y$
 $f_{xx} = 4(x^2 + y^2) + 8x^2 - 4$, $f_{xy} = 8xy$, $f_{yy} = 4(x^2 + y^2) + 8y^2 + 4$
Punti stazionari: $(0, 0)$, $(\pm 1, 0)$; $\det H(\pm 1, 0) > 0$, $\det H(0, 0) < 0$; $(\pm 1, 0)$
 sono **minimi globali**: $\|u\| \rightarrow +\infty \Rightarrow f(u) \rightarrow +\infty$; $(0, 0)$ è una sella.

2. Sia $g(x, y) = x^3 + y^3 - 3xy$.
 Notiamo che $\nabla g = 0 \Leftrightarrow x^2 = y$, $y^2 = x$ e quindi $(0, 0), (1, 1)$ sono gli unici
 punti critici di g . Poi
 $g_{xx} = 6x$, $g_{yy} = 6y$, $g_{xy} = -3$ e quindi

- $H_f(0, 0)$ ha autovalori ± 3 e quindi $(0, 0)$ è di sella

- $H_f(1, 1)$ ha autovalori positivi e quindi $(1, 1)$ è di minimo, infatti il punto di
 minimo assoluto di g .

INTEGRALI DIPENDENTI DA PARAMETRO

DIPENDENZA CONTINUA

Sia $f \in C((t_0 - \delta, t_0 + \delta) \times (a, b))$, $-\infty \leq a < b \leq +\infty$. Supponiamo

(equidominatezza) $\exists g$ integrabile in (a, b) : $|f(t, x)| \leq g(x) \quad \forall t, x$

Allora $t \rightarrow \int_a^b f(t, x) dx$ è continua in $(t_0 - \delta, t_0 + \delta)$

Prova. Grazie ad Heine-Cantor, $t_n \rightarrow t \Rightarrow f_n(x) := f(t_n, x)$ converge uniforme-
 mente sui sottoinsiemi chiusi e limitati di (a, b) . Ciò, insieme alla equidominatezza,
 assicura che $\int_a^b f(t_n, x) dx \rightarrow \int_a^b f(t, x) dx$.

DERIVAZIONE SOTTO SEGNO DI INTEGRALE.

Sia $f \in C([t_0 - \delta, t_0 + \delta] \times (a, b))$, $-\infty \leq a < b \leq +\infty$. Supponiamo che

i) $\frac{\partial f}{\partial t}$ esiste ed è continua in $[t_0 - \delta, t_0 + \delta] \times (a, b)$

ii) $\exists g$ integrabile in (a, b) : $|f_t(t, x)| \leq g(x) \quad \forall t, x$.

Allora $t \rightarrow \int_a^b f(t, x) dx$ é derivabile $\forall t \in (t_0 - \delta, t_0 + \delta)$ e

$$\frac{d}{dt} \int_a^b f(t, x) dx = \int_a^b \frac{\partial f}{\partial t}(t, x) dx$$

Prova. Sia $t \in (t_0 - \delta, t_0 + \delta)$, $\tau_n \rightarrow 0$. É $\frac{f(t+\tau_n, x) - f(t, x)}{\tau_n} - f_t(t, x) =$

$$\frac{1}{\tau_n} \int_0^1 \left[\frac{d}{ds} f(t + s\tau_n, x) \right] ds - f_t(t, x) = \int_0^1 [f_t(t + s\tau_n, x) - f_t(t, x)] ds \rightarrow_n 0$$

uniformemente in $x \in [c, d] \subset (a, b)$ (Heine-Cantor). Inoltre

$$\int_0^1 |f_t(t + s\tau_n, x) - f_t(t, x)| ds \leq 2g(x) \quad \text{Dunque}$$

$$\left| \frac{\int_a^b f(t + \tau_n, x) dx - \int_a^b f(t, x) dx}{\tau_n} - \int_a^b f_t(t, x) dx \right| \leq \int_a^b \left[\int_0^1 |f_t(t + s\tau_n, x) - f_t(t, x)| ds \right] dx \rightarrow_n 0$$

ESEMPIO. $f(t, x) = \frac{\sin x}{x} e^{-tx}$, $f_t(t, x) = -\sin x e^{-tx}$, $t > 0$, $x \in \mathbf{R}$ sono continue.

Inoltre $t \geq t_0 > 0 \Rightarrow |f(t, x)| + |f_t(t, x)| \leq e^{-t_0 x}$ e $\int_0^{+\infty} e^{-t_0 x} dx = \frac{1}{t_0}$.

Dunque $\frac{d}{dt} \int_0^{+\infty} \frac{\sin x}{x} e^{-tx} dx = - \int_0^{+\infty} e^{-tx} \sin x dx$. Integrando per parti si ottiene

$$\frac{d}{dt} \int_0^{+\infty} \frac{\sin x}{x} e^{-tx} dx = -\frac{1}{1+t^2}$$

CONVOLUZIONE Siano $f, g : \mathbf{R} \rightarrow \mathbf{R}$, $\varphi \in C_0^\infty$ f continua. Allora

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

é C^∞ e

$$\frac{d^k}{dx^k} (f * \varphi)(x) = (f * \frac{d^k \varphi}{dx^k})(x)$$

Prova. La prima affermazione segue effettuando il cambio di variabile $t = x - y$. Si può dunque derivare sotto segno di integrale, giacché c'è equidominatezza:

$$\left| \frac{d^k}{dx^k} f(t)g(x-t) \right| = |f(t)g^{(k)}(x-t)| \leq c_k |f(t)| \chi_{[-R,R]}, \quad c_k := \sup_{x \in \mathbf{R}} |g^{(k)}(x)|$$

ove R è tale che $g(x-t) = 0$ se $|t| \geq R$ e $|x| \leq c$.

REGOLARIZZAZIONE PER CONVOLUZIONE

Sia $\varphi \in C_0^\infty$, $\varphi \geq 0$, $\int_{-\infty}^{+\infty} \varphi(x) dx = 1$ (φ nucleo regolarizzante).

Sia $\varphi_\epsilon(x) := \frac{1}{\epsilon} \varphi\left(\frac{x}{\epsilon}\right)$. (successione regolarizzante)

Sia f continua. Allora

$$f * \varphi_\epsilon \xrightarrow{\epsilon \rightarrow 0} f \quad \text{uniformemente sui limitati}$$

Prova .

$$\varphi_\epsilon(x) = 0 \text{ se } |x| \geq \epsilon \quad \text{e} \quad \int_{-\infty}^{+\infty} \varphi_\epsilon(x-y) dy = 1 \quad \Rightarrow$$

$$\sup_{|x| \leq R} |f(x) - (f * \varphi_\epsilon)(x)| \leq \sup_{|x| \leq R} \int_{-\infty}^{+\infty} |f(x) - f(y)| \varphi_\epsilon(x-y) dy \leq \sup_{|x| \leq R, |x-y| \leq \epsilon} |f(x) - f(y)|$$

Ma $\sup_{|x| \leq R, |x-y| \leq \epsilon} |f(x) - f(y)| \xrightarrow{\epsilon \rightarrow 0} 0$, perché

f è uniformemente continua in $[R - \epsilon, R + \epsilon]$.