

Matematika III – 3. přednáška

Funkce více proměnných: věta o implicitní funkci, vázané extrémym

Masarykova univerzita
Fakulta informatiky

30. 9. 2008

Obsah přednášky

- 1 Inverzní a implicitní zobrazení
 - Věta o inverzním zobrazení
 - Implicitně zadaná zobrazení
- 2 Tečny a normály k implicitně zadaným plochám
 - Gradient funkce
 - Tečné a normálové prostory
- 3 Vázané extrémym
 - Metoda Lagrangeových multiplikátorů

Doporučené zdroje

- Martin Panák, Jan Slovák, Drsná matematika, e-text.

Doporučené zdroje

- Martin Panák, Jan Slovák, Drsná matematika, e-text.
- Zuzana Došlá, Ondřej Došlý, Diferenciální počet funkcí více proměnných, MU Brno, 2006, 150 s.

Doporučené zdroje

- Martin Panák, Jan Slovák, Drsná matematika, e-text.
- Zuzana Došlá, Ondřej Došlý, Diferenciální počet funkcí více proměnných, MU Brno, 2006, 150 s.
- Zuzana Došlá, Roman Plch, Petr Sojka, Diferenciální počet funkcí více proměnných s programem Maple, MU Brno, 1999, 273 s. (příp. <http://www.math.muni.cz/~plch/mapm>).

Doporučené zdroje

- Martin Panák, Jan Slovák, Drsná matematika, e-text.
- Zuzana Došlá, Ondřej Došlý, Diferenciální počet funkcí více proměnných, MU Brno, 2006, 150 s.
- Zuzana Došlá, Roman Plch, Petr Sojka, Diferenciální počet funkcí více proměnných s programem Maple, MU Brno, 1999, 273 s. (příp. <http://www.math.muni.cz/~plch/mapm>).
- *Předmětové záložky v IS MU*

Plán přednášky

- 1 Inverzní a implicitní zobrazení
 - Věta o inverzním zobrazení
 - Implicitně zadaná zobrazení
- 2 Tečny a normály k implicitně zadaným plochám
 - Gradient funkce
 - Tečné a normálové prostory
- 3 Vázané extrémym
 - Metoda Lagrangeových multiplikátorů

Věta o inverzním zobrazení

Věta

Nechť $F : E_n \rightarrow E_n$ je spojitě diferencovatelné zobrazení na nějakém okolí bodu $x_0 \in E_n$ a necht' je Jacobiho matice $D^1F(x_0)$ invertibilní. Pak na nějakém okolí bodu x_0 existuje inverzní zobrazení F^{-1} a jeho diferenciál v bodě $F(x_0)$ je inverzním zobrazením k $D^1F(x_0)$, tzn. je zadán inverzní maticí k Jacobiho matici zobrazení F v bodě x_0 .

Věta o inverzním zobrazení

Věta

Nechť $F : E_n \rightarrow E_n$ je spojitě diferencovatelné zobrazení na nějakém okolí bodu $x_0 \in E_n$ a necht' je Jacobiho matice $D^1F(x_0)$ invertibilní. Pak na nějakém okolí bodu x_0 existuje inverzní zobrazení F^{-1} a jeho diferenciál v bodě $F(x_0)$ je inverzním zobrazením k $D^1F(x_0)$, tzn. je zadán inverzní maticí k Jacobiho matici zobrazení F v bodě x_0 .

Princip důkazu: Z pravidla pro derivování složené funkce vyplývá, že pokud diferencovatelná inverze existuje, pak musí být její Jacobiho matice inverzí k původní Jacobiho matici (srovnejte s případem 1 proměnné). Důkaz poměrně komplikovaným způsobem vyvozuje, že díky invertovatelnosti Jacobiho matice existuje diferencovatelná inverze.

Věta o implicitní funkci

Pro jednoduchost vyložíme ideu v rovině E_2 :

Věta o implicitní funkci

Pro jednoduchost vyložíme ideu v rovině E_2 :

Pro spojitě diferencovatelnou funkci $F(x, y) : E_2 \rightarrow \mathbb{R}$ hledíme body $[x, y]$, ve kterých platí $F(x, y) = 0$. Příkladem může být třeba obvyklá (implicitní) definice přímek a kružnic:

$$F(x, y) = ax + by + c = 0$$

$$F(x, y) = (x - s)^2 + (y - t)^2 - r^2 = 0, \quad r > 0.$$

Věta o implicitní funkci

Pro jednoduchost vyložíme ideu v rovině E_2 :

Pro spojitě diferencovatelnou funkci $F(x, y) : E_2 \rightarrow \mathbb{R}$ hledíme body $[x, y]$, ve kterých platí $F(x, y) = 0$. Příkladem může být třeba obvyklá (implicitní) definice přímek a kružnic:

$$F(x, y) = ax + by + c = 0$$

$$F(x, y) = (x - s)^2 + (y - t)^2 - r^2 = 0, \quad r > 0.$$

V prvním případě je (při $b \neq 0$) předpisem zadaná funkce

$$y = f(x) = -\frac{a}{b}x - \frac{c}{b}$$

pro všechna x .

Věta o implicitní funkci

Pro jednoduchost vyložíme ideu v rovině E_2 :

Pro spojitě diferencovatelnou funkci $F(x, y) : E_2 \rightarrow \mathbb{R}$ hledejme body $[x, y]$, ve kterých platí $F(x, y) = 0$. Příkladem může být třeba obvyklá (implicitní) definice přímek a kružnic:

$$F(x, y) = ax + by + c = 0$$

$$F(x, y) = (x - s)^2 + (y - t)^2 - r^2 = 0, \quad r > 0.$$

V prvním případě je (při $b \neq 0$) předpisem zadaná funkce

$$y = f(x) = -\frac{a}{b}x - \frac{c}{b}$$

pro všechna x . Ve druhém případě umíme pouze pro $[a, b]$ splňující rovnici kružnice a $b \neq t$ najít okolí bodu a , na kterém nastane

$$\begin{aligned} \text{jedna z možností: } & y = f(x) = t + \sqrt{r^2 - (x - s)^2}, \\ & y = f(x) = t - \sqrt{r^2 - (x - s)^2}. \end{aligned}$$

Body $[s \pm r, t]$ také vyhovují rovnici kružnice, platí v nich ale $F_y(s \pm r, t) = 0$, což vystihuje polohu tečny ke kružnici v těchto bodech rovnoběžné s osou y . **V těchto bodech neumíme najít okolí, na němž by kružnice byla popsána jako funkce $y = f(x)$.**

Body $[s \pm r, t]$ také vyhovují rovnici kružnice, platí v nich ale $F_y(s \pm r, t) = 0$, což vystihuje polohu tečny ke kružnici v těchto bodech rovnoběžné s osou y . **V těchto bodech neumíme najít okolí, na němž by kružnice byla popsána jako funkce $y = f(x)$.** Navíc umíme spočítat i **derivace**:

$$f'(x) = -\frac{1}{2} \frac{2(x-s)}{\sqrt{r^2 - (x-s)^2}} = -\frac{x-s}{y-t} = -\frac{F_x}{F_y}.$$

Body $[s \pm r, t]$ také vyhovují rovnici kružnice, platí v nich ale $F_y(s \pm r, t) = 0$, což vystihuje polohu tečny ke kružnici v těchto bodech rovnoběžné s osou y . **V těchto bodech neumíme najít okolí, na němž by kružnice byla popsána jako funkce $y = f(x)$.**

Navíc umíme spočítat i **derivace**:

$$f'(x) = -\frac{1}{2} \frac{2(x-s)}{\sqrt{r^2 - (x-s)^2}} = -\frac{x-s}{y-t} = -\frac{F_x}{F_y}.$$

Naopak, pokud budeme chtít najít závislost $x = f(y)$ takovou, aby $F(f(y), y) = 0$, pak v okolí bodů $(s \pm r, t)$ bez problémů uspějeme. Všimněme si, že v těchto bodech je partiální derivace F_x nenulová.

Shrňme pozorování (pro pouhé dva příklady):

Shrňme pozorování (pro pouhé dva příklady):

Pro funkci $F(x, y)$ a bod $[a, b] \in E_2$ takový, že $F(a, b) = 0$, umíme najít funkci $y = f(x)$ splňující $F(x, f(x)) = 0$, pokud je $F_y(a, b) \neq 0$. V takovém případě umíme i vypočítat $f'(x) = -F_x/F_y$. Z následující věty plyne, že takto to platí vždy, navíc rozšířené i na libovolné počty proměnných.

Shrňme pozorování (pro pouhé dva příklady):

Pro funkci $F(x, y)$ a bod $[a, b] \in E_2$ takový, že $F(a, b) = 0$, umíme najít funkci $y = f(x)$ splňující $F(x, f(x)) = 0$, pokud je $F_y(a, b) \neq 0$. V takovém případě umíme i vypočítat $f'(x) = -F_x/F_y$. Z následující věty plyne, že takto to platí vždy, navíc rozšířené i na libovolné počty proměnných.

Poslední tvrzení o derivaci přitom je dobře zapamatovatelné (i pochopitelné) z výrazu pro diferenciál:

$$0 = dF = F_x dx + F_y dy = (F_x + F_y f'(x)) dx.$$

Věta (O implicitní funkci)

Nechť $F : E_{n+1} \rightarrow \mathbb{R}$ je spojitě diferencovatelná funkce na otevřeném okolí bodu $[\mathbf{x}_0, y_0] \in E_n \times \mathbb{R}$, ve kterém je $F(\mathbf{x}_0, y_0) = 0$ a $\frac{\partial F}{\partial y}(\mathbf{x}_0, y_0) \neq 0$. Potom existuje spojitá funkce $f : E_n \rightarrow \mathbb{R}$ definovaná na nějakém okolí U bodu $\mathbf{x}_0 \in E_n$ taková, že $F(x, f(x)) = 0$ pro všechny $x \in U$.

Navíc má funkce f v okolí bodu \mathbf{x}_0 parciální derivace splňující

$$\frac{\partial f}{\partial x_i}(x) = -\frac{\frac{\partial F}{\partial x_i}(x, f(x))}{\frac{\partial F}{\partial y}(x, f(x))}.$$

Příklad

Určete lokální extrémny funkce $z = f(x, y)$, která je určena implicitně rovnicí $F(x, y, z) = x^2 + y^2 + z^2 - xz - \sqrt{2}yz = 1$.

Příklad

Určete lokální extrémny funkce $z = f(x, y)$, která je určena implicitně rovnicí $F(x, y, z) = x^2 + y^2 + z^2 - xz - \sqrt{2}yz = 1$.

Řešení

Derivováním rovnosti podle x a y dostáváme:

$$2x + 2z \cdot z_x - z - x \cdot z_x - \sqrt{2}yz_x = 0$$

$$2y + 2z \cdot z_y - x \cdot z_y - \sqrt{2}z - \sqrt{2}yz_y = 0,$$

odkud vyjádříme

$$z_x = \frac{z - 2x}{2z - x - \sqrt{2}y}, \quad z_y = \frac{\sqrt{2}z - 2y}{2z - x - \sqrt{2}y}.$$

Řešení (pokr.)

Stacionární body musí splňovat: $z_x = 0$, $z_y = 0$, tj. $z = 2x = \sqrt{2}y$, a tedy $y = \sqrt{2}x$. Dosazením do původní rovnice dostáváme stacionární body $[1, \sqrt{2}, 2]$ a $[-1, -\sqrt{2}, -2]$. V těchto bodech je $F_z \neq 0$ (je to zároveň jmenovatel všech zde vystupujících zlomků), proto je v jejich okolí implicitně určena jistá funkce $z = f(x, y)$. Dalším derivováním implicitní rovnice vypočteme parciální derivace f 2. řádu:

$$z_{xx} = -\frac{2}{2z - x - \sqrt{2}y}, \quad z_{xy} = 0, \quad z_{yy} = -\frac{2}{2z - x - \sqrt{2}y}.$$

Řešení (pokr.)

Stacionární body musí splňovat: $z_x = 0$, $z_y = 0$, tj. $z = 2x = \sqrt{2}y$, a tedy $y = \sqrt{2}x$. Dosazením do původní rovnice dostáváme stacionární body $[1, \sqrt{2}, 2]$ a $[-1, -\sqrt{2}, -2]$. V těchto bodech je $F_z \neq 0$ (je to zároveň jmenovatel všech zde vystupujících zlomků), proto je v jejich okolí implicitně určena jistá funkce $z = f(x, y)$. Dalším derivováním implicitní rovnice vypočteme parciální derivace f 2. řádu:

$$z_{xx} = -\frac{2}{2z - x - \sqrt{2}y}, \quad z_{xy} = 0, \quad z_{yy} = -\frac{2}{2z - x - \sqrt{2}y}.$$

Ve stacionárních bodech je Hf negativně, resp. pozitivně definitní, proto zde nastávají lokální maximum, resp. minimum funkce f .

Nejobecnější případ, kdy definujeme implicitně zadané zobrazení, popisuje následující věta (v případě $n=1$ kopíruje větu o implicitní funkci).

Nejobecnější případ, kdy definujeme implicitně zadané zobrazení, popisuje následující věta (v případě $n=1$ kopíruje větu o implicitní funkci).

Věta (O implicitním zobrazení)

Nechť $F : E_{m+n} \rightarrow E_n$ je spojitě diferencovatelné zobrazení na otevřeném okolí bodu $[x_0, y_0] \in E_m \times E_n = E_{m+n}$, v němž platí $F(x_0, y_0) = \mathbf{0}$ a $\det D_y^1 F \neq 0$. Potom existuje spojitě diferencovatelné zobrazení $G : E_m \rightarrow E_n$ definované na nějakém okolí U bodu $x_0 \in E_m$ s obrazem $G(U)$, který obsahuje bod y_0 , a takové, že $F(x, G(x)) = 0$ pro všechny $x \in U$.

Navíc je Jacobiho matice $D^1 G$ zobrazení G na okolí bodu x_0 zadána součinem matic

$$D^1 G(x) = -(D_y^1 F)^{-1}(x, G(x)) \cdot D_x^1 F(x, G(x)).$$

Plán přednášky

- 1 Inverzní a implicitní zobrazení
 - Věta o inverzním zobrazení
 - Implicitně zadaná zobrazení
- 2 Tečny a normály k implicitně zadaným plochám
 - Gradient funkce
 - Tečné a normálové prostory
- 3 Vázané extrémny
 - Metoda Lagrangeových multiplikátorů

Gradient funkce

Definition

Pro spojitě diferencovatelnou funkci $f(x_1, \dots, x_n) : E_n \rightarrow \mathbb{R}$ se vektor

$$df = \left(\frac{\partial f}{\partial x_1}, \dots, \frac{\partial f}{\partial x_n} \right)$$

nazývá **gradient funkce** f .

V technické a fyzikální literatuře se často zapisuje také jako $\text{grad } f$.

Gradient funkce

Definition

Pro spojitě diferencovatelnou funkci $f(x_1, \dots, x_n) : E_n \rightarrow \mathbb{R}$ se vektor

$$df = \left(\frac{\partial f}{\partial x_1}, \dots, \frac{\partial f}{\partial x_n} \right)$$

nazývá **gradient funkce** f .

V technické a fyzikální literatuře se často zapisuje také jako $\text{grad } f$.

Rovnost $f(x_1, \dots, x_n) = b$ s pevnou hodnotou $b \in \mathbb{R}$ zadává podmnožinu $M \subset E_n$, která má vlastnosti $(n-1)$ -rozměrné nadplochy.

Gradient funkce

Definition

Pro spojitě diferencovatelnou funkci $f(x_1, \dots, x_n) : E_n \rightarrow \mathbb{R}$ se vektor

$$df = \left(\frac{\partial f}{\partial x_1}, \dots, \frac{\partial f}{\partial x_n} \right)$$

nazývá **gradient funkce** f .

V technické a fyzikální literatuře se často zapisuje také jako $\text{grad } f$.

Rovnost $f(x_1, \dots, x_n) = b$ s pevnou hodnotou $b \in \mathbb{R}$ zadává podmnožinu $M \subset E_n$, která má vlastnosti $(n-1)$ -rozměrné nadplochy. Přesněji: pokud je vektor parciálních derivací nenulový, můžeme lokálně množinu M popsat jako graf spojitě diferencovatelné funkce v $n-1$ proměnných.

Gradient funkce

Definition

Pro spojitě diferencovatelnou funkci $f(x_1, \dots, x_n) : E_n \rightarrow \mathbb{R}$ se vektor

$$df = \left(\frac{\partial f}{\partial x_1}, \dots, \frac{\partial f}{\partial x_n} \right)$$

nazývá **gradient funkce** f .

V technické a fyzikální literatuře se často zapisuje také jako $\text{grad } f$.

Rovnost $f(x_1, \dots, x_n) = b$ s pevnou hodnotou $b \in \mathbb{R}$ zadává podmnožinu $M \subset E_n$, která má vlastnosti $(n-1)$ -rozměrné nadplochy. Přesněji: pokud je vektor parciálních derivací nenulový, můžeme lokálně množinu M popsat jako graf spojitě diferencovatelné funkce v $n-1$ proměnných.

Hovoříme v této souvislosti také o **úrovňových množinách** M_b (analogie vrstevnic v př. $n=2$).

Na derivacích křivek ležících v úrovněvé množině M_b se bude diferenciál df vždy vyčíslovat nulově:

$f(c(t)) = b$ pro všechna t , proto

$$\frac{d}{dt}f(c(t)) = df(c'(t)) = 0.$$

Na derivacích křivek ležících v úrovnňové množině M_b se bude diferencíál df vždy vyčíslovat nulově:

$f(c(t)) = b$ pro všechna t , proto

$$\frac{d}{dt}f(c(t)) = df(c'(t)) = 0.$$

Pro obecný vektor $v = (v_1, \dots, v_n) \in E_n$ je velikost příslušné směrové derivace funkce f :

$$|d_v f| = \left| \frac{\partial f}{\partial x_1} v_1 + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_n} v_n \right| = \cos \varphi \|df\| \|v\|$$

kde φ je odchylka vektoru v od gradientu funkce f . Dokázali jsme:

Na derivacích křivek ležících v úrovněvé množině M_b se bude diferenciál df vždy vyčíslovat nulově:

$f(c(t)) = b$ pro všechna t , proto

$$\frac{d}{dt}f(c(t)) = df(c'(t)) = 0.$$

Pro obecný vektor $v = (v_1, \dots, v_n) \in E_n$ je velikost příslušné směrové derivace funkce f :

$$|d_v f| = \left| \frac{\partial f}{\partial x_1} v_1 + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_n} v_n \right| = \cos \varphi \|df\| \|v\|$$

kde φ je odchylka vektoru v od gradientu funkce f . Dokázali jsme:

Věta

Směr zadaný gradientem v bodě $x = (x_1, \dots, x_n)$ je právě ten směr, ve kterém funkce f nejrychleji roste.

Tečná rovina k neprázdné úrovněvé množině M_b v okolí jejího bodu s nenulovým gradientem df je určena ortogonálním doplňkem ke gradientu.

Násobkům gradientu v tomto případě říkáme **normálový vektor** nadplochy M_b .

Věta

Pro funkci f n proměnných a bod $P = (a_1, \dots, a_n) \in M_b$ v jehož okolí je M_b grafem funkce $(n - 1)$ proměnných je implicitní rovnice pro tečnou nadrovinu

$$0 = \frac{\partial f}{\partial x_1}(P) \cdot (x_1 - a_1) + \dots + \frac{\partial f}{\partial x_n}(P) \cdot (x_n - a_n).$$

Example (Model osvětlení 3D objektu)

Pro 2D povrch známe směr v dopadu světla, tj. máme množinu M zadanou implicitně rovnicí $f(x, y, z) = 0$ a vektor v . Intenzitu osvětlení bodu $P \in M$ pak definujeme jako $I_0 \cos \varphi$, kde φ je úhel mezi normálou zadanou gradientem a vektorem opačným ke směru světla. (Znaménko říká, kterou stranu plochy osvětlujeme, I_0 je tzv. svítivost.)

Např. $v = (1, 1, -1)$ (tj. „šikmo dolů“) a

$f(x, y, z) = x^2 + y^2 + z^2 - 1$. Pro bod $P = (x, y, z) \in M$

$$I(P) = \frac{\text{grad } f \cdot v}{\|\text{grad } f\| \|v\|} I_0 = \frac{-2x - 2y + 2z}{2\sqrt{3}} I_0.$$

Dle očekávání je plnou intenzitou I_0 osvětlen bod

$P = \frac{1}{\sqrt{3}}(-1, -1, 1)$ na povrchu koule.

Tečné a normálové prostory

Obecné dimenze: funkce $F = (f_1, \dots, f_n) : E_{m+n} \rightarrow E_n$ a n rovnic

$$f_i(x_1, \dots, x_{m+n}) = b_i, \quad i = 1, \dots, n.$$

dle věty o implicitní funkci je „většinou“ množina všech řešení (x_1, \dots, x_{m+n}) grafem zobrazení $G : E_m \rightarrow E_n$. Pro pevnou volbu $b = (b_1, \dots, b_n)$ je samozřejmě množinou M všech řešení průnik nadploch $M(b_i, f_i)$ příslušejících jednotlivým rovnicím $f_i = b_i$. Totéž platí pro tečné směry a normálové směry:

Tečné a normálové prostory

Obecné dimenze: funkce $F = (f_1, \dots, f_n) : E_{m+n} \rightarrow E_n$ a n rovnic

$$f_i(x_1, \dots, x_{m+n}) = b_i, \quad i = 1, \dots, n.$$

dle věty o implicitní funkci je „většinou“ množina všech řešení (x_1, \dots, x_{m+n}) grafem zobrazení $G : E_m \rightarrow E_n$. Pro pevnou volbu $b = (b_1, \dots, b_n)$ je samozřejmě množinou M všech řešení průnik nadploch $M(b_i, f_i)$ příslušejících jednotlivým rovnicím $f_i = b_i$.

Totéž platí pro tečné směry a normálové směry:

Afinní podprostor v E_{m+n} obsahující právě všechny tečny k M bodem P dán rovnicemi:

$$0 = \frac{\partial f_1}{\partial x_1}(P) \cdot (x_1 - a_1) + \dots + \frac{\partial f_1}{\partial x_n}(P) \cdot (x_{m+n} - a_{m+n})$$

⋮

$$0 = \frac{\partial f_n}{\partial x_1}(P) \cdot (x_1 - a_1) + \dots + \frac{\partial f_n}{\partial x_n}(P) \cdot (x_{m+n} - a_{m+n}).$$

Tento podprostor se nazývá **tečný prostor** k (implicitně zadané) ploše M v bodě P . **Normálový prostor** v bodě P je afinní podprostor generovaný bodem P a gradienty všech funkcí f_1, \dots, f_n v bodě P , tj. řádky Jacobiho matice D^1F .

Tento podprostor se nazývá **tečný prostor** k (implicitně zadané) ploše M v bodě P . **Normálový prostor** v bodě P je afinní podprostor generovaný bodem P a gradienty všech funkcí f_1, \dots, f_n v bodě P , tj. řádky Jacobiho matice D^1F .

Příklad

Spočtěme tečnu a normálový prostor ke kuželosečce v E_3 .
Uvažujme rovnici

$$0 = f(x, y, z) = z - \sqrt{x^2 + y^2}$$

kuželu s vrcholem v počátku a rovinu zadanou

$$0 = g(x, y, z) = z - 2x + y + 1.$$

Bod $P = (1, 0, 1)$ patří jak kuželu, tak rovině a průnik M těchto dvou ploch je křivka.

Příklad (pokr.)

Její tečnou v bodě P bude přímka zadaná rovnicemi

Příklad (pokr.)

Její tečnou v bodě P bude přímka zadaná rovnicemi

$$\begin{aligned}0 &= -\frac{1}{2\sqrt{x^2+y^2}}2x \Big|_{x=1,y=0} \cdot (x-1) - \frac{1}{2\sqrt{x^2+y^2}}2y \Big|_{x=1,y=0} \cdot y \\ &\quad + 1 \cdot (z-1) \\ &= -x + z \\ 0 &= -2(x-1) + y + (z-1) = -2x + y + z + 1\end{aligned}$$

Příklad (pokr.)

Její tečnou v bodě P bude přímka zadaná rovnicemi

$$\begin{aligned} 0 &= -\frac{1}{2\sqrt{x^2+y^2}}2x \Big|_{x=1,y=0} \cdot (x-1) - \frac{1}{2\sqrt{x^2+y^2}}2y \Big|_{x=1,y=0} \cdot y \\ &\quad + 1 \cdot (z-1) \\ &= -x + z \end{aligned}$$

$$0 = -2(x-1) + y + (z-1) = -2x + y + z + 1$$

zatímco rovina kolmá k naší křivce bodem P bude parametricky dána výrazem

$$(1, 0, 1) + \tau(-1, 0, 1) + \sigma(-2, 1, 1)$$

s parametry τ a σ .

Plán přednášky

- 1 Inverzní a implicitní zobrazení
 - Věta o inverzním zobrazení
 - Implicitně zadaná zobrazení
- 2 Tečny a normály k implicitně zadaným plochám
 - Gradient funkce
 - Tečné a normálové prostory
- 3 **Vázané extrémny**
 - Metoda Lagrangeových multiplikátorů

Již dříve jsme se zabývali úlohou nalézt absolutní extrém dané funkce na (uzavřené) množině, což vedlo na vyšetření lokálních extrémů funkce na hranici této množiny. Jinými slovy, na hledání extrémů funkce v bodech, které jsou *vázané* nějakou další podmínkou.

Metoda Lagrangeových multiplikátorů

V předchozím příkladu jsme viděli, že normálový vektor (tj. gradient) funkce, k níž hledáme extrém, musí být ve vyšetřovaném bodě prvkem normálového prostoru k ploše (v témže bodě). Toto samozřejmě platí i obecně.

Metoda Lagrangeových multiplikátorů

V předchozím příkladu jsme viděli, že normálový vektor (tj. gradient) funkce, k níž hledáme extrém, musí být ve vyšetřovaném bodě prvkem normálového prostoru k ploše (v témže bodě). Toto samozřejmě platí i obecně.

Pokud je M ve všech svých bodech grafem hladkého zobrazení, musí být každý extrém $P \in M$ stacionárním bodem, tj. pro každou křivku $c(t) \subset M$ procházející přes $P = c(0)$ musí být $h(c(t))$ extrémem pro tuto funkci jedné proměnné. Proto musí platit

$$\frac{d}{dt} h(c(t))|_{t=0} = d_{c'(0)} h(P) = dh(P)(c'(0)) = 0.$$

Metoda Lagrangeových multiplikátorů

V předchozím příkladu jsme viděli, že normálový vektor (tj. gradient) funkce, k níž hledáme extrém, musí být ve vyšetřovaném bodě prvkem normálového prostoru k ploše (v témže bodě). Toto samozřejmě platí i obecně.

Pokud je M ve všech svých bodech grafem hladkého zobrazení, musí být každý extrém $P \in M$ stacionárním bodem, tj. pro každou křivku $c(t) \subset M$ procházející přes $P = c(0)$ musí být $h(c(t))$ extrémem pro tuto funkci jedné proměnné. Proto musí platit

$$\frac{d}{dt} h(c(t))|_{t=0} = d_{c'(0)} h(P) = dh(P)(c'(0)) = 0.$$

Tato vlastnost je ekvivalentní tvrzení, že gradient h leží v normálovém podprostoru (přesněji v jeho zaměření). Takové body $P \in M$ budeme nazývat **stacionární body** funkce h vzhledem k vazbám F .

V praxi mívají optimalizační úlohy často $m + n$ parametrů, které jsou vázány n podmínkami. V našem jazyce diferenciálního počtu tedy hledáme extrémny spojitě diferencovatelné funkce h na množině bodů M zadaných implicitně rovnicí $F(x_1, \dots, x_{m+n}) = \mathbf{0}$ ($F : E_{m+n} \rightarrow E_n$).

Normálový prostor k naší množině M je generován řádky Jacobiho matice zobrazení F a stacionární body jsou proto ekvivalentně určeny následujícím tvrzením, kterému se říká **metoda Lagrangeových multiplikátorů**:

V praxi mívají optimalizační úlohy často $m + n$ parametrů, které jsou vázány n podmínkami. V našem jazyce diferenciálního počtu tedy hledáme extrémy spojitě diferencovatelné funkce h na množině bodů M zadaných implicitně rovnicí $F(x_1, \dots, x_{m+n}) = 0$ ($F : E_{m+n} \rightarrow E_n$).

Normálový prostor k naší množině M je generován řádky Jacobiho matice zobrazení F a stacionární body jsou proto ekvivalentně určeny následujícím tvrzením, kterému se říká **metoda Lagrangeových multiplikátorů**:

Věta

Nechť $F = (f_1, \dots, f_n) : E_{m+n} \rightarrow E_n$ je spojitě diferencovatelná v okolí bodu P , $F(P) = 0$ a M je zadána implicitně rovnicí $F(x_1, \dots, x_{m+n}) = 0$, přičemž hodnota matice D^1F v bodě P je n . Pak P je stacionárním bodem spojitě diferencovatelné funkce $h : E_{m+n} \rightarrow \mathbb{R}$ právě, když existují reálné parametry $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ takové, že

$$\text{grad } h = \lambda_1 \text{ grad } f_1 + \dots + \lambda_n \text{ grad } f_n.$$

Všimněme si počtu neznámých a rovnic v tomto algoritmu: gradienty jsou vektory o $m + n$ souřadnicích, tedy požadavek z věty dává $m + n$ rovnic. Jako neznámé máme jednak souřadnice x_1, \dots, x_{m+n} hledaných stacionárních bodů P , ale navíc také n parametrů λ_i v hledané lineární kombinaci. Zbývá však požadavek, že hledaný bod P patří implicitně zadané množině M , což představuje dalších n rovnic. Celkem tedy máme $2n + m$ rovnic pro $2n + m$ proměnných a proto lze očekávat, že řešením bude diskrétní množina bodů P (tj. každý z nich bude izolovaným bodem).

Absolutní extrémny

Výklad o vázaných extrémny jsme začali tím, že pro nalezení absolutních extrémů funkce na kompaktní množině často potřebujeme vyšetření extrémů na množině bodů vázaných nějakou podmínkou.

Absolutní extrémny

Výklad o vázaných extrémny jsme začali tím, že pro nalezení absolutních extrémů funkce na kompaktní množině často potřebujeme vyšetření extrémů na množině bodů vázaných nějakou podmínkou.

Ilustrujme si to na příkladu:

Příklad

Maximalizujte $f(x, y) = 2x + y$ za podmínky $\frac{x^2}{4} + y^2 \leq 1$.

Řešení

Množina určená vazební podmínkou je uzavřená a ohraničená, proto zde nabývá jakákoliv spojitá funkce svých extrémů, a to buď ve stacionárních bodech nebo na hranici. Snadno se ale přesvědčíme ($df(x, y) = (2, 1)$), že uvnitř množiny extrémů nejsou. Proto maximalizujeme funkci f za podmínky $\frac{x^2}{4} + y^2 = 1$.

Řešení

Množina určená vazební podmínkou je uzavřená a ohraničená, proto zde nabývá jakákoliv spojitá funkce svých extrémů, a to buď ve stacionárních bodech nebo na hranici. Snadno se ale přesvědčíme ($df(x, y) = (2, 1)$), že uvnitř množiny extrémy nejsou. Proto maximalizujeme funkci f za podmínky $\frac{x^2}{4} + y^2 = 1$.

Sestrojíme Lagrangeovu funkci

$L(x, y, \lambda) = 2x + y - \lambda(\frac{x^2}{4} + y^2 - 1)$. Pak dostáváme:

$$0 = L_x = 2 - \lambda \frac{x}{2}$$

$$0 = L_y = 1 - 2\lambda y$$

$$0 = \frac{x^2}{4} + y^2 - 1.$$

Řešení

Množina určená vazební podmínkou je uzavřená a ohraničená, proto zde nabývá jakákoliv spojitá funkce svých extrémů, a to buď ve stacionárních bodech nebo na hranici. Snadno se ale přesvědčíme ($df(x, y) = (2, 1)$), že uvnitř množiny extrémny nejsou. Proto maximalizujeme funkci f za podmínky $\frac{x^2}{4} + y^2 = 1$.

Sestrojíme Lagrangeovu funkci

$L(x, y, \lambda) = 2x + y - \lambda(\frac{x^2}{4} + y^2 - 1)$. Pak dostáváme:

$$0 = L_x = 2 - \lambda \frac{x}{2}$$

$$0 = L_y = 1 - 2\lambda y$$

$$0 = \frac{x^2}{4} + y^2 - 1.$$

Odtud snadno $x = \frac{4}{\lambda}$, $y = \frac{1}{2\lambda}$, a tedy $\lambda = \frac{\sqrt{17}}{2}$, $x = \frac{8}{\sqrt{17}}$, $y = \frac{1}{\sqrt{17}}$
(resp. $\lambda = -\frac{\sqrt{17}}{2}$, $x = -\frac{8}{\sqrt{17}}$, $y = -\frac{1}{\sqrt{17}}$ pro minimum).