

$y = y(u, v)$, когда имеются производные высших порядков, а также когда речь идет о функциях большего числа переменных.

Упражнение 22. Преобразовать выражение $|\nabla u|^2$, где $u = u(x, y)$, к ортогональным координатам ξ, η , т. е. таким координатам, что

$$\frac{\partial x}{\partial \xi} \frac{\partial x}{\partial \eta} + \frac{\partial y}{\partial \xi} \frac{\partial y}{\partial \eta} = 0.$$

23. Преобразовать уравнение $y'' - xy'^3 + e^y y'^3 = 0$, приняв y за новую независимую переменную, а x — за функцию от y .

24. В уравнении $\frac{\partial^2 z}{\partial x^2} - \frac{\partial^2 z}{\partial y^2} = 0$ перейти к новым независимым переменным $u = x + y, v = x - y$.

25. В выражении $\frac{1}{2} z \left(\frac{1}{x^2} \frac{\partial^2 z}{\partial x^2} + \frac{1}{y^2} \frac{\partial^2 z}{\partial y^2} \right) + \frac{1}{2} \left[\left(\frac{1}{x} \frac{\partial z}{\partial x} \right)^2 + \left(\frac{1}{y} \frac{\partial z}{\partial y} \right)^2 \right] - \frac{1}{2} z \left(\frac{1}{x^3} \frac{\partial z}{\partial x} + \frac{1}{y^3} \frac{\partial z}{\partial y} \right)$ перейти к переменным $u, v, w = w(u, v)$, если $u = x^2, v = y^2, w = z^2$ (ответ: $\frac{\partial^2 w}{\partial u^2} + \frac{\partial^2 w}{\partial v^2}$).

Задача 27. В n -мерном пространстве преобразовать выражение $|\nabla u|^2$, где $u = u(x_1, \dots, x_n)$, к ортогональным координатам ξ_1, \dots, ξ_n , т. е. таким координатам, что при $i \neq k$ выполняется равенство

$$\sum_{i=1}^n \frac{\partial x_j}{\partial \xi_i} \frac{\partial x_j}{\partial \xi_k} = 0, \quad k = 1, 2, \dots, n.$$

§ 42. ЗАВИСИМОСТЬ ФУНКЦИЙ

2.1. ПОНЯТИЕ ЗАВИСИМОСТИ ФУНКЦИЙ. НЕОБХОДИМОЕ УСЛОВИЕ ЗАВИСИМОСТИ ФУНКЦИЙ

Определение 1. Пусть на открытом множестве $G \subset R^n$ заданы непрерывно дифференцируемые функции

$$y_i = \varphi_i(x), \quad i = 1, 2, \dots, m, \quad x = (x_1, \dots, x_n) \in G. \quad (42.1)$$

Если существуют открытое множество D в пространстве $R_{y_1, \dots, y_{m-1}}^{m-1}$ и непрерывно дифференцируемая на D функция $\Phi(y_1, \dots, y_{m-1})$, такие, что в любой точке $x \in G$ выполняются условия $(\varphi_1(x), \dots, \varphi_{m-1}(x)) \in D$ и $\Phi(\varphi_1(x), \dots, \varphi_{m-1}(x)) = \varphi_m(x)$, то функция φ_m называется зависимой на множестве G от функций $\varphi_1, \dots, \varphi_{m-1}$.

Определение 2. Если среди функций системы (42.1) есть функция, зависимая от остальных на множестве G , то эта система называется зависимой на множестве G .

Если ни одна функция системы (42.1) не зависит от остальных на множестве G , то эта система называется независимой на G .

Иногда для краткости вместо выражения «зависимая (независимая) система функций» будем просто говорить «зависимые (соответственно независимые) функции».

В вопросе зависимости системы функций (42.1) фундаментальную роль играет матрица Якоби этой системы

$$\left\| \frac{\partial y_i}{\partial x_j} \right\|, \quad i=1, 2, \dots, m; \quad j=1, 2, \dots, n, \quad (42.2)$$

i — номер строки, j — номер столбца.

Теорема 1 (необходимое условие зависимости функций). Пусть $m \leq n$ и система функций (42.1) зависима на открытом множестве G . Тогда в любой точке этого множества ранг матрицы Якоби (42.2) *) этой системы меньше m .

Доказательство. По условию, система функций (42.1) зависима на G , т. е. по крайней мере одна из этих функций зависит от остальных. Пусть для определенности φ_m зависит от $\varphi_1, \dots, \varphi_{m-1}$:

$$\varphi_m(x) = \Phi(\varphi_1(x), \dots, \varphi_{m-1}(x)), \quad x \in G,$$

где Φ — непрерывно дифференцируемая функция от $(m-1)$ аргументов y_1, \dots, y_{m-1} . Отсюда

$$\frac{\partial y_m}{\partial x_j} = \sum_{i=1}^{m-1} \frac{\partial \Phi}{\partial y_i} \frac{\partial y_i}{\partial x_j} \quad \text{для всех } j=1, 2, \dots, n.$$

Эта формула показывает, что m -я строка матрицы Якоби (42.2) в каждой точке $x \in G$ является линейной комбинацией остальных строк этой матрицы, и, значит, ранг матрицы Якоби (42.2) меньше m в каждой точке $x \in G$. \square

Следствие 1. Пусть $m = n$ и система функций (42.1) зависима на G . Тогда ее якобиан $\frac{\partial(y_1, \dots, y_n)}{\partial(x_1, \dots, x_n)}$ равен нулю во всех точках множества G .

Следствие 2 (достаточные условия независимости функций). Пусть $m \leq n$ и пусть ранг матрицы Якоби (42.2) хоть в одной точке открытого множества G равен m . Тогда система (42.1) независима на множестве G .

Следствие 1 получается сразу из доказанной теоремы при $m = n$.

Следствие 2 легко доказывается от противного.

Поскольку строки матрицы Якоби (42.2) являются координатами градиентов функций (42.1), то теорему 1 можно перефразировать следующим образом.

*) Напомним, что рангом матрицы называется максимальное число ее линейно независимых строк. Это число совпадает с максимальным порядком минора этой матрицы, не равного нулю.

Если система функций (42.1) зависима в области G , то градиенты $\nabla\varphi_1, \dots, \nabla\varphi_m$ этих функций линейно зависимы в каждой точке G .

42.2. ДОСТАТОЧНЫЕ УСЛОВИЯ ЗАВИСИМОСТИ ФУНКЦИЙ

В этом пункте сохраним обозначения предыдущего пункта и будем, как и раньше, предполагать, что функции (42.1) непрерывно дифференцируемы на открытом множестве $G \subset R^n$.

Теорема 2 (достаточные условия зависимости функций). Пусть ранг матрицы Якоби (42.2) системы функций (42.1) в каждой точке открытого множества G не превышает числа r , $r < m \leq n$, а в некоторой точке $x^{(0)} \in G$ равен r , иначе говоря, существуют такие переменные x_{j_1}, \dots, x_{j_r} и функции $y_{i_1} = \varphi_{i_1}(x), \dots, y_{i_r} = \varphi_{i_r}(x)$, что

$$\frac{\partial (y_{i_1}, \dots, y_{i_r})}{\partial (x_{j_1}, \dots, x_{j_r})} \Big|_{x^{(0)}} \neq 0. \quad (42.3)$$

Тогда все r функций, входящих в условие (42.3), независимы на множестве G и существует окрестность точки $x^{(0)}$, такая, что любая из оставшихся $m - r$ функций зависит на этой окрестности от указанных r функций.

Доказательство. Пусть для простоты записи условие (42.3) имеет вид

$$\frac{\partial (y_1, \dots, y_r)}{\partial (x_1, \dots, x_r)} \Big|_{x^{(0)}} \neq 0 \quad (42.4)$$

(этого всегда можно добиться, перенумеровав в случае необходимости функции и аргументы системы (42.1) в нужном порядке). Согласно следствию 2 из теоремы 1 п. 42.1., функции y_1, \dots, y_r независимы в G .

Покажем, что каждая из остальных зависит от них в некоторой окрестности точки $x^{(0)} = (x_1^{(0)}, \dots, x_n^{(0)})$. Пусть $y_i^{(0)} = \varphi_i(x^{(0)})$, $i = 1, 2, \dots, m$. Рассмотрим систему первых r функций системы (42.1):

$$\begin{aligned} y_1 &= \varphi_1(x_1, \dots, x_n) \\ &\dots \dots \dots \dots \dots \dots \\ y_r &= \varphi_r(x_1, \dots, x_n). \end{aligned} \quad (42.5)$$

Прежде всего выберем такое η_0 , чтобы всякая точка $x = (x_1, \dots, x_n)$, принадлежащая η_0 -кубической окрестности точки $x^{(0)}$, т. е. всякая точка x , для которой $|x_i - x_i^{(0)}| < \eta_0$, $i = 1, 2, \dots, n$, принадлежала множеству $G: x \in G$. Это всегда возможно в силу его открытости.

Далее, в силу условия (42.4) и теоремы о неявных функциях (см. п. 41.3) система (42.5) разрешима относительно переменных

Для доказательства равенства (42.8) зафиксируем одно из j ($j=r+1, \dots, n$) и координаты x_k с индексами k , принимающими значения $r+1, \dots, j-1, j+1, \dots, n$, обозначив их через x_k^* , причем выберем x_k^* так, чтобы $|x_k^* - x_k^{(0)}| < \delta$, $k=r+1, \dots, j-1, j+1, \dots, n$.

Рассмотрим отображение

$$\begin{aligned} y_1 &= y_1, \\ &\dots \\ y_r &= y_r, \end{aligned} \quad (42.9)$$

$$y_{r+1} = \varphi_{r+1}(f_1^*, \dots, f_r^*, x_{r+1}^*, \dots, x_{j-1}^*, x_j, x_{j+1}^*, \dots, x_n^*),$$

где $f_k^* = f_k(y_1, \dots, y_r, x_{r+1}^*, \dots, x_{j-1}^*, x_j, x_{j+1}^*, \dots, x_n^*)$, кубической окрестности $U^{(j)}$ точки $(y_1^{(0)}, \dots, y_r^{(0)}, x_j^{(0)})$, задаваемой неравенствами

$$|y_k - y_k^{(0)}| < \delta, \quad k=1, 2, \dots, r, \quad |x_j - x_j^{(0)}| < \delta.$$

Символически, чтобы подчеркнуть, какие именно переменные меняются, изобразим отображение (42.9) в виде

$$(y_1, \dots, y_r, x_j) \rightarrow (y_1, \dots, y_r, y_{r+1}).$$

Это отображение непрерывно дифференцируемо на $U^{(j)}$; его матрица Якоби имеет вид

$$\left\| \begin{array}{cccc} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ \frac{\partial y_{r+1}}{\partial y_1} & \frac{\partial y_{r+1}}{\partial y_2} & \frac{\partial y_{r+1}}{\partial y_r} & \frac{\partial y_{r+1}}{\partial x_j} \end{array} \right\|$$

и потому

$$\frac{\partial (y_1, \dots, y_r, y_{r+1})}{\partial (y_1, \dots, y_r, x_j)} = \frac{\partial y_{r+1}}{\partial x_j}, \quad (42.10)$$

т. е. якобиан рассматриваемого отображения равен интересующей нас производной.

На окрестности $U^{(j)}$ это отображение можно представить в виде композиции двух отображений: непрерывно дифференцируемого отображения

$$x_1 = f_1(y_1, \dots, y_r, x_{r+1}^*, \dots, x_{j-1}^*, x_j, x_{j+1}^*, \dots, x_n^*),$$

$$x_r = f_r(y_1, \dots, y_r, x_{r+1}^*, \dots, x_{j-1}^*, x_j, x_{j+1}^*, \dots, x_n^*),$$

$$x_j = x_j$$

окрестности $U^{(j)}$ и непрерывно дифференцируемого отображения

$$\begin{aligned}
 y_1 &= \Phi_1(x_1, \dots, x_r, x_{r+1}^*, \dots, x_j^*-1, x_j, x_j^*+1, \dots, x_n^*), \\
 &\dots \\
 y_r &= \Phi_r(x_1, \dots, x_r, x_{r+1}^*, \dots, x_j^*-1, x_j, x_j^*+1, \dots, x_n^*), \\
 y_{r+1} &= \Phi_{r+1}(x_1, \dots, x_r, x_{r+1}^*, \dots, x_j^*-1, x_j, x_j^*+1, \dots, x_n^*)
 \end{aligned}$$

окрестности точки $(x_1^{(0)}, \dots, x_r^{(0)}, x_j^{(0)})$, задаваемой неравенствами

$$|x_i - x_i^{(0)}| < \eta, \quad i = 1, 2, \dots, r, \quad |x_j - x_j^{(0)}| < \delta.$$

В силу выбора чисел δ и η композиция этих отображений, которую для наглядности можно символически изобразить в виде

$$(y_1, \dots, y_r, x_j) \rightarrow (x_1, \dots, x_r, x_j) \rightarrow (y_1, \dots, y_r, y_{r+1}),$$

определена и непрерывно дифференцируема на окрестности $U^{(j)}$. Первое из этих отображений непрерывно дифференцируемо в окрестности $U^{(j)}$ точки $(y_1^{(0)}, \dots, y_r^{(0)}, x_j^{(0)})$, а второе непрерывно дифференцируемо в соответствующей окрестности точки $(x_1^{(0)}, \dots, x_r^{(0)}, x_j^{(0)})$. Поэтому из (42.10) и из свойств якобианов отображений (см. п. 41.7) имеем

$$\frac{\partial y_{r+1}}{\partial x_j} = \frac{\partial (y_1, \dots, y_r, y_{r+1})}{\partial (y_1, \dots, y_r, x_j)} = \frac{\partial (y_1, \dots, y_r, y_{r+1})}{\partial (x_1, \dots, x_r, x_j)} \frac{\partial (x_1, \dots, x_r, x_j)}{\partial (y_1, \dots, y_r, x_j)} \quad (42.11)$$

В силу условия теоремы ранг матрицы Якоби на множестве G меньше или равен r , следовательно,

$$\frac{\partial (y_1, \dots, y_r, y_{r+1})}{\partial (x_1, \dots, x_r, x_j)} = 0$$

всюду на G . Поэтому из (42.11) сразу следует, что для любой точки $(y_1, \dots, y_r, x_j) \in U^{(j)}$ и, следовательно, для любой точки

$$(y_1, \dots, y_r, x_{r+1}^*, \dots, x_j^*-1, x_j, x_j^*+1, \dots, x_n^*) \in U$$

справедливо равенство (42.8). Поскольку координаты x_k^* были фиксированы произвольным образом, лишь бы $|x_k^* - x_k^{(0)}| < \delta$; $k = r+1, \dots, j-1, j+1, \dots, n$, то это означает, что равенство (42.8) справедливо на всей окрестности U .

Таким образом, функция (42.7) зависит только от переменных y_1, \dots, y_r . Обозначив ее символом Φ , получим

$$\Phi_{r+1}(f_1, \dots, f_r, x_{r+1}, \dots, x_n) = \Phi(y_1, \dots, y_r).$$

Выберем теперь так $\delta_0, \delta_0 < \delta$ и $\delta_0 < \eta$, чтобы при $|x_i - x_i^{(0)}| < \delta_0, i = 1, 2, \dots, n$, выполнялись бы неравенства

$$|y_i - y_i^{(0)}| < \delta, \quad j = 1, 2, \dots, r.$$

Это возможно в силу непрерывности функций $y_j = \Phi_j(x_1, \dots, x_n), j = 1, 2, \dots, r$, системы (42.5) в точке $x^{(0)}$.

В силу доказанного для любой точки x δ_0 -кубической окрестности точки $x^{(0)}$, т. е. для любой такой точки $x = (x_1, \dots, x_n)$, что

$$|x_i - x_i^{(0)}| < \delta_0, \quad i = 1, 2, \dots, n,$$

будет справедливо тождество

$$\Phi_{r+1}(x) = \Phi(\Phi_1(x), \dots, \Phi_r(x)),$$

т. е. в указанной окрестности точки $x^{(0)}$ функции $\Phi_1, \dots, \Phi_r, \Phi_{r+1}$ зависимы.

Аналогично доказывается и зависимость каждой из функций $\Phi_{r+2}, \dots, \Phi_m$ от Φ_1, \dots, Φ_r в некоторой окрестности точки $x^{(0)}$. \square

Аналогично необходимому условию зависимости функций достаточные условия также можно сформулировать в терминах градиентов. Для простоты ограничимся случаем $r = m - 1$.

Если градиенты $\nabla\Phi_1, \dots, \nabla\Phi_m$ линейно зависимы во всех точках области G , то какова бы ни была точка $x \in G$, в которой $m - 1$ из указанных градиентов линейно независимы, существует ее окрестность, в которой функции Φ_1, \dots, Φ_m зависимы. При этом, если, например, градиенты $\nabla\Phi_1, \dots, \nabla\Phi_{m-1}$ линейно независимы в рассматриваемой точке, и, следовательно, градиент $\nabla\Phi_m$ в этой точке является их линейной комбинацией, то в указанной окрестности функция Φ_m зависит от функций $\Phi_1, \dots, \Phi_{m-1}$.

Следует обратить внимание на то, что достаточные условия зависимости функций, установленные в этом пункте, имеют локальный характер в отличие от результатов предшествующего пункта, имеющих глобальный характер. Это означает следующее: если система m непрерывно дифференцируемых функций (42.1) зависима на открытом множестве $G \subset \mathbb{R}^n$, то согласно теореме 1 п. 42.1 в каждой точке этого множества ранг матрицы Якоби этой системы меньше m (соответственно если хотя бы в одной точке множества G ранг рассматриваемой матрицы равен m , то система независима на всем множестве G). Что же касается теоремы 2 настоящего пункта, то она утверждает лишь, что если в какой-то точке $x^{(0)} \in G$ выполняются условия этой теоремы, то только на некоторой окрестности этой точки (а не на всем множестве G) данная система функций является зависимой системой. Таким образом, действительно, утверждение теоремы 2 имеет локальный характер.

Добавим еще, что если в каждой точке $x^{(0)}$ открытого множества G выполняются условия теоремы 2, то, конечно, в этом случае в некоторой окрестности каждой точки рассматриваемая система функций будет зависимой. Однако теорема 2 не гарантирует, что эта зависимость будет одной и той же во всех указанных окрестностях, т. е. из теоремы 2 не следует, что в разных точках одни и те же функции будут зависимыми от других и что функции Φ , «осуществляющие» зависимости одних и тех же функций, рассматриваемых на разных окрестностях, будут совпа-

дать в точках пересечения этих окрестностей. Следовательно, из теоремы 2 не следует, что система функций, удовлетворяющая условиям этой теоремы во всех точках $x^{(0)}$ множества G , будет зависимой на всем множестве G в целом, в едином смысле, т. е. в смысле определения 1. Это и означает, что теорема 2 не имеет глобального характера.

Заметим, что существует несколько более общий подход к понятию зависимости функций, позволяющий построить глобальную теорию этого вопроса, однако мы не будем на этом останавливаться.

Пример. Рассмотрим систему функций

$$\begin{aligned} u &= \sin(x+y), \\ v &= \cos(x+y). \end{aligned} \quad (42.12)$$

Якобиан этой системы равен нулю на всей плоскости

$$\begin{vmatrix} \cos(x+y) & \cos(x+y) \\ -\sin(x+y) & -\sin(x+y) \end{vmatrix} = 0,$$

и, как легко видеть, ранг матрицы Якоби этой системы равен единице во всех точках плоскости.

Согласно теореме 2, функции (42.12) зависимы в окрестности каждой точки плоскости. В данном случае зависимость функций легко находится в явном виде, например на открытом множестве точек (x, y) , для которых $\cos(x+y) > 0$, она может быть задана формулой $v = \sqrt{1-u^2}$.

Упражнения 1. Пусть $u = x^2 + y^2 + z^2$, $v = xy + yz + zx$, $w = x + y + z$. Доказать, что функции u , v , w зависимы и найти уравнение, выражающее их зависимость.

2. Исследовать вопрос о зависимости функций $u = \xi^3 + \eta^3 + \zeta^3$, $v = \xi\eta\zeta$, $w = \xi^2 + \eta^2 + \zeta^2$, $z = \xi\eta + \eta\zeta + \zeta\xi$.

Задача 28. Функция $u = u(x, y)$ называется гармонической в плоской области, если во всех точках этой области она удовлетворяет уравнению $\Delta u = 0$ (см. (41.109)). Доказать, что две гармонические функции зависимы в плоской области тогда и только тогда, когда они линейно зависимы.

§ 43. УСЛОВНЫЙ ЭКСТРЕМУМ

43.1. ПОНЯТИЕ УСЛОВНОГО ЭКСТРЕМУМА

Пусть на открытом множестве $G \subset R^n$ заданы функции

$$y_i = f_i(x), \quad i = 1, 2, \dots, m, \quad (43.1)$$

$x = (x_1, \dots, x_n) \in G$. Обозначим через E множество точек $x \in G$, в которых все функции f_i , $i = 1, 2, \dots, m$, обращаются в ноль:

$$E = \{x : f_i(x) = 0, \quad i = 1, \dots, m, \quad x \in G\}. \quad (43.2)$$

Уравнения

$$f_i(x) = 0, \quad i = 1, 2, \dots, m, \quad (43.3)$$

будем называть *уравнениями связи*.