

Matematika III – 6. týden

Integrace podruhé

Jan Slovák

Masarykova univerzita
Fakulta informatiky

24. října – 28. října 2016

Obsah přednášky

- 1 Literatura
- 2 Násobné integrály
- 3 Integrály závislé na parametrech
- 4 Integrál funkcí více proměnných
- 5 Změna souřadnic

Plán přednášky

- 1 Literatura
- 2 Násobné integrály
- 3 Integrály závislé na parametrech
- 4 Integrál funkcí více proměnných
- 5 Změna souřadnic

Kde je dobré číst?

- Zuzana Došlá, Roman Plch, Petr Sojka, Diferenciální počet funkcí více proměnných s programem Maple, MU Brno, 1999, 273 s.
- J. Slovák, M. Panák, M. Bulant, Matematika drsně a svižně, Muni Press, Brno 2013, v+773 s., elektronická edice www.math.muni.cz/Matematika_drsne_svizne
- Riley, K.F., Hobson, M.P., Bence, S.J. Mathematical Methods for Physics and Engineering, second edition, Cambridge University Press, Cambridge 2004, ISBN 0 521 89067 5, xxiii + 1232 pp.

Plán přednášky

- 1 Literatura
- 2 **Násobné integrály**
- 3 Integrály závislé na parametrech
- 4 Integrál funkcí více proměnných
- 5 Změna souřadnic

Násobné integrály

Riemannovsky integrovatelné množiny zejména zahrnují případy, kdy lze S definovat pomocí spojitě funkční závislosti souřadnic hraničních bodů tak, že pro danou první souřadnici x umíme zadat dvěma funkcemi rozsah další souřadnice $y \in [\varphi(x), \psi(x)]$, poté rozsah další souřadnice $z \in [\eta(x, y), \zeta(x, y)]$ atd.

Násobné integrály

Riemannovsky integrovatelné množiny zejména zahrnují případy, kdy lze S definovat pomocí spojitě funkční závislosti souřadnic hraničních bodů tak, že pro danou první souřadnici x umíme zadat dvěma funkcemi rozsah další souřadnice $y \in [\varphi(x), \psi(x)]$, poté rozsah další souřadnice $z \in [\eta(x, y), \zeta(x, y)]$ atd.

Theorem

V případě množiny S zadané jako výše a Riemannovsky integrovatelné funkce f na S je Riemannův integrál vyčíslen formulí

$$\int_S f(x, y, \dots, z) dx \dots dz = \int_a^b \left(\int_{\varphi(x)}^{\psi(x)} \dots \left(\int_{\eta(x, y, \dots)}^{\zeta(x, y, \dots)} f(x, y, \dots, z) dz \right) \dots dy \right) dx$$

Důkaz.

Výsledek vyplývá docela snadno přímo z definice Riemannova integrálu pomocí konečných součtů. Stačí si pečlivě hlídat vhodné poskládání jednotlivých sčítanců konečných součtů tak, aby vycházely postupně přiblížení integrálů ve vnitřních závorkách. \square

Přímým důsledkem je:

Theorem (Fubiniho věta)

Pro vícerozměrný interval $S = [a_1, b_1] \times [a_2, b_2] \times \dots \times [a_n, b_n]$ a spojitou funkci $f(x_1, \dots, x_n)$ na S je násobný integrál

$$\int_S f(x_1, \dots, x_n) dx_1 \dots dx_n = \int_{a_1}^{b_1} \int_{a_2}^{b_2} \dots \int_{a_n}^{b_n} f(x_1, \dots, x_n) dx_1 \dots dx_n$$

nezávislý na pořadí ve kterém postupně integraci provádíme.

Plán přednášky

- 1 Literatura
- 2 Násobné integrály
- 3 Integrály závislé na parametrech**
- 4 Integrál funkcí více proměnných
- 5 Změna souřadnic

Integrály závislé na parametrech

Jestliže integrujeme podle jedné proměnné x funkci $n + 1$ proměnných $f(x, y_1, \dots, y_n)$, potom výsledek bude funkcí $F(y_1, \dots, y_n)$ v zbývajících proměnných.

Integrály závislé na parametrech

Jestliže integrujeme podle jedné proměnné x funkci $n + 1$ proměnných $f(x, y_1, \dots, y_n)$, potom výsledek bude funkcí $F(y_1, \dots, y_n)$ v zbývajících proměnných.

Theorem

Pro spojitě diferencovatelnou funkci $f(x, y_1, \dots, y_n)$ definovanou pro x z konečného intervalu $[a, b]$ a na nějakém okolí bodu $a = (a_1, \dots, a_n) \in \mathbb{R}^n$ uvažujme integrál

$$F(y_1, \dots, y_n) = \int_a^b f(x, y_1, \dots, y_n) dx.$$

Potom F je spojitá a pro všechny indexy $j = 1, \dots, n$ platí

$$\frac{\partial F}{\partial y_j}(a) = \int_a^b \frac{\partial f}{\partial y_j}(x, a_1, \dots, a_n) dx$$

Ověření spojitosti plyne z přímo z definice Riemannova integrálu v jedné proměnné.

Ta vyčísluje pro libovolnou spojitou funkci jeho hodnotu pomocí aproximací konečnými součty (ekvivalentně horními, dolními nebo Riemannovými součty s libovolnými reprezentanty).

Tvrzení nyní okamžitě vyplývá ze skutečnosti, že spojitá funkce na kompaktní množině je ve skutečnosti stejnoměrně spojitá.

Diferencovatelnost podle parametru je hezkým cvičením na Fubiniho větu.

Předchozí výsledky o extrémech funkcí více proměnných nyní mají přímé použití např. pro minimalizaci ploch nebo objemů objektů zadanými funkcemi v závislosti na parametrech.

Využití je širší. Jako další příklad můžeme uvést možnost přímého derivování hodnot integrálních transformací.

Plán přednášky

- 1 Literatura
- 2 Násobné integrály
- 3 Integrály závislé na parametrech
- 4 Integrál funkcí více proměnných**
- 5 Změna souřadnic

Tak jak jsme motivovali integrování představou o výpočtu plochy pod grafem funkce jedné proměnné, můžeme prakticky stejně postupovat u objemu části trojrozměrného prostoru pod grafem funkce $z = f(x, y)$ dvou proměnných. Místo výběru malých intervalů $[x_i, x_{i+1}]$ dělících celý interval, přes který integrujeme, a přiblížením příslušné části objemu ploškou obdélníku s výškou danou hodnotou funkce f v reprezentantu tohoto intervalu ξ_i , tj. výrazem

$$f(\xi_i)(x_{i+1} - x_i)$$

budeme pracovat s děleními v obou proměnných a hodnotami reprezentujícími výšku grafu nad tímto obdélníčkem v rovině.

Tak jak jsme motivovali integrování představou o výpočtu plochy pod grafem funkce jedné proměnné, můžeme prakticky stejně postupovat u objemu části trojrozměrného prostoru pod grafem funkce $z = f(x, y)$ dvou proměnných. Místo výběru malých intervalů $[x_i, x_{i+1}]$ dělících celý interval, přes který integrujeme, a přiblížením příslušné části objemu ploškou obdélníku s výškou danou hodnotou funkce f v reprezentantu tohoto intervalu ξ_i , tj. výrazem

$$f(\xi_i)(x_{i+1} - x_i)$$

budeme pracovat s děleními v obou proměnných a hodnotami reprezentujícími výšku grafu nad tímto obdélníčkem v rovině.
Co jsou obory integrace?

Tak jak jsme motivovali integrování představou o výpočtu plochy pod grafem funkce jedné proměnné, můžeme prakticky stejně postupovat u objemu části trojrozměrného prostoru pod grafem funkce $z = f(x, y)$ dvou proměnných. Místo výběru malých intervalů $[x_i, x_{i+1}]$ dělících celý interval, přes který integrujeme, a přiblížením příslušné části objemu ploškou obdélníku s výškou danou hodnotou funkce f v reprezentantu tohoto intervalu ξ_i , tj. výrazem

$$f(\xi_i)(x_{i+1} - x_i)$$

budeme pracovat s děleními v obou proměnných a hodnotami reprezentujícími výšku grafu nad tímto obdélníčkem v rovině.

Co jsou obory integrace?

Nejjednodušším přístupem je uvažovat pouze obory integrace S , které jsou dány jako součiny intervalů, tj. jsou zadány rozsahem $x \in [a, b]$ a $y \in [c, d]$.

Hovoříme v této souvislosti o **vícerozměrném intervalu**.

Pokud je S jiná ohraničená množina v \mathbb{R}^2 , pracujeme místo ní s dostatečně velikou oblastí $[a, b] \times [c, d]$, ale upravíme naši funkci tak, že $f(x, y) = 0$ pro všechny body mimo S .

Definice Riemannova integrálu věrně sleduje náš postup pro jednu proměnnou.

Pokud je S jiná ohraničená množina v \mathbb{R}^2 , pracujeme místo ní s dostatečně velikou oblastí $[a, b] \times [c, d]$, ale upravíme naši funkci tak, že $f(x, y) = 0$ pro všechny body mimo S .

Definice Riemannova integrálu věrně sleduje náš postup pro jednu proměnnou.

Integrál existuje, jestliže pro každou volbu posloupnosti dělení Ξ (nyní ve všech proměnných zároveň) a reprezentantů jednotlivých krychliček

$$\xi_i \in [x_i, x_{i+1}] \times \dots \times [z_j, z_{j+1}] \subset \mathbb{R}^n,$$

s maximální velikostí mezi všemi použitými intervaly jdoucí k nule, budou integrální součty

$$S_{\Xi, \xi} = \sum_{i, \dots, j} f(\xi_i)(x_{i+1} - x_i) \dots (z_{j+1} - z_j).$$

konvergovat k jedné hodnotě, kterou zapisujeme

$$\int_S f(x, \dots, z) dx \dots dz$$

Pro všechny spojité funkce f opět lze dokázat existenci Riemannova integrálu a tento výsledek budeme umět snadno rozšířit pro „dostatečně spojité“ funkce na „dostatečně rozumných“ oborech integrace.

Pro všechny spojité funkce f opět lze dokázat existenci Riemannova integrálu a tento výsledek budeme umět snadno rozšířit pro „dostatečně spojitě“ funkce na „dostatečně rozumných“ oborech integrace.

Definition

Omezenou množinu $S \subset \mathbb{R}^n$ nazýváme **Riemannovsky měřitelnou**^a, jestliže je její charakteristická funkce, definovaná $\chi(x) = 1$ pro $x \in S$ a $\chi(x) = 0$ jinak, Riemannovsky integrovatelná.

^aLépe by bylo říkat „měřitelnou pomocí Riemannova integrálu“, této míře se ve skutečnosti říká Jordanova-Peanova míra.

Definice Riemannova integrálu sice nedává rozumný návod, jak hodnoty integrálů skutečně vypočítat, okamžitě ale vede k základním vlastnostem Riemannova integrálu (srovnejte s vlastnostmi integrálu v jedné proměnné):

Definice Riemannova integrálu sice nedává rozumný návod, jak hodnoty integrálů skutečně vypočíst, okamžitě ale vede k základním vlastnostem Riemannova integrálu (srovnejte s vlastnostmi integrálu v jedné proměnné):

Theorem

Množina Riemannovsky integrovatelných funkcí na vícerozměrném intervalu $S \subset \mathbb{R}^n$ je vektorovým prostorem a Riemannův integrál je na něm lineární formou.

Pokud je obor integrace S zadán jako disjunktní sjednocení konečně mnoha Riemannovsky měřitelných oborů S_i , je integrál funkce f přes S dán součtem integrálů přes obory S_i .

Theorem

Ohraničená funkce $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ s kompaktním nosičem je Riemannovsky integrovatelná, právě když je množina jejích bodů nespojitosti Riemannovsky měřitelnou množinou míry nuly.

Theorem

Ohraničená funkce $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ s kompaktním nosičem je Riemannovsky integrovatelná, právě když je množina jejích bodů nespojitosti Riemannovsky měřitelnou množinou míry nuly.

Theorem

Spojitě obrazy Riemannovsky měřitelných množin jsou opět měřitelné.

Theorem

Ohraničená funkce $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ s kompaktním nosičem je Riemannovsky integrovatelná, právě když je množina jejích bodů nespojitosti Riemannovsky měřitelnou množinou míry nuly.

Theorem

Spojité obrazy Riemannovsky měřitelných množin jsou opět měřitelné.

Theorem

Riemannova míra množin je nezávislá na volbě ortogonálních souřadnic v E_n .

Plán přednášky

- 1 Literatura
- 2 Násobné integrály
- 3 Integrály závislé na parametrech
- 4 Integrál funkcí více proměnných
- 5 Změna souřadnic**

Změna souřadnic při integraci

Při výpočtu integrálů funkcí jedné proměnné jsme používali transformace souřadnic jako mimořádně silný nástroj. Obdobně lze transformace využívat pro integrály funkcí více proměnných.

Změna souřadnic při integraci

Při výpočtu integrálů funkcí jedné proměnné jsme používali transformace souřadnic jako mimořádně silný nástroj. Obdobně lze transformace využívat pro integrály funkcí více proměnných.

Připomeňme nejdříve jak je to s transformacemi pro jednu proměnnou:

Integrovaný výraz $f(x)dx$ vyjadřuje plochu obdélníčku určeného (linearizovaným) přírůstkem proměnné x a hodnotou $f(x)$. Pokud proměnnou transformujeme vztahem $x = u(t)$, vzjadřuje se i linearizovaný přírůstek jako

$$dx = \frac{du}{dt} dt$$

a proto i příslušný příspěvek pro integrál je vyjádřen jako

$$f(u(t)) \frac{du}{dt} dt,$$

přičemž buď předpokládáme, že znaménko derivace $u'(t)$ je kladné,

Intuitivně je postup v n proměnných docela podobný, pouze musíme použít znalostí z lineární algebry o objemu rovnoběžnostěnů.

Intuitivně je postup v n proměnných docela podobný, pouze musíme použít znalostí z lineární algebry o objemu rovnoběžnostěnů.

Theorem

Nechť $G(t_1, \dots, t_n) : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$, $(x_1, \dots, x_n) = G(t_1, \dots, t_n)$, je spojitě diferencovatelné zobrazení, $S = G(T)$ a T jsou Riemannovsky měřitelné množiny a $f : S \rightarrow \mathbb{R}$ spojitá funkce. Potom platí

$$\int_S f(x_1, \dots, x_n) dx_1 \dots dx_n = \int_T f(G(t_1, \dots, t_n)) |\det(D^1 G(t_1, \dots, t_n))| dt_1 \dots dt_n.$$

Podrobný formální důkaz nebudeme prezentovat, je však přímočarou realizací výše uvedené úvahy ve spojení s definicí Riemannova integrálu.

Abychom si přiblížili obsah tvrzení poslední věty, uvedeme jeho speciální případ pro integrál funkce $f(x, y)$ ve dvou proměnných a transformaci

$$G(s, t) = (g(s, t), h(s, t)).$$

Dostáváme

$$\int_{G(T)} f(x, y) dx dy = \int_T f(g(s, t), h(s, t)) \left| \frac{\partial g}{\partial s} \frac{\partial h}{\partial t} - \frac{\partial g}{\partial t} \frac{\partial h}{\partial s} \right| ds dt.$$

Abychom si přiblížili obsah tvrzení poslední věty, uvedeme jeho speciální případ pro integrál funkce $f(x, y)$ ve dvou proměnných a transformaci

$$G(s, t) = (g(s, t), h(s, t)).$$

Dostáváme

$$\int_{G(T)} f(x, y) dx dy = \int_T f(g(s, t), h(s, t)) \left| \frac{\partial g}{\partial s} \frac{\partial h}{\partial t} - \frac{\partial g}{\partial t} \frac{\partial h}{\partial s} \right| ds dt.$$

Úplně konkrétně spočteme integrál z charakteristické funkce kružnice o poloměru R (tj. její plochu)

Abychom si přiblížili obsah tvrzení poslední věty, uvedeme jeho speciální případ pro integrál funkce $f(x, y)$ ve dvou proměnných a transformaci

$$G(s, t) = (g(s, t), h(s, t)).$$

Dostáváme

$$\int_{G(T)} f(x, y) dx dy = \int_T f(g(s, t), h(s, t)) \left| \frac{\partial g}{\partial s} \frac{\partial h}{\partial t} - \frac{\partial g}{\partial t} \frac{\partial h}{\partial s} \right| ds dt.$$

Úplně konkrétně spočteme integrál z charakteristické funkce kružnice o poloměru R (tj. její plochu)

Nejprve spočítáme Jacobiho matici transformace $x = r \cos \theta$,
 $y = r \sin \theta$

$$D^1 G = \begin{pmatrix} \cos \theta & -r \sin \theta \\ \sin \theta & r \cos \theta \end{pmatrix}.$$

Proto je determinant z této matice roven

$$\det D^1 G(r, \theta) = r(\sin^2 \theta + \cos^2 \theta) = r.$$

Můžeme tedy přímo počítat pro kružnici S o poloměru R , která je obrazem obdélníku $(r, \theta) \in [0, R] \times [0, 2\pi] = T$:

$$\int_S dx dy = \int_0^{2\pi} \int_0^R r dr d\theta = \int_0^R 2\pi r dr = \pi R^2.$$