

Analysis II

Vorlesung 48

Lokale Extrema von Funktionen in mehreren Variablen

Wir wollen mit den Mitteln der Differentialrechnung Kriterien erarbeiten, in welchen Punkten eine Funktion

$$f: G \longrightarrow \mathbb{R}$$

ein lokales Minimum oder ein lokales Maximum annimmt. Wenn man sich den Graph einer solchen Funktion als ein Gebirge über der Grundmenge G vorstellt, so geht es also um die Gipfel und die Senken des Gebirges. Der folgende Satz liefert ein notwendiges Kriterium für die Existenz eines lokalen Extremums, das das entsprechende Kriterium in einer Variablen verallgemeinert.

SATZ 48.1. *Sei V ein endlichdimensionaler reeller Vektorraum und $G \subseteq V$ eine offene Teilmenge. Es sei*

$$f: G \longrightarrow \mathbb{R}$$

eine Funktion, die im Punkt $P \in G$ ein lokales Extremum besitzt. Dann gelten folgende Aussagen.

- (1) *Wenn f in P in Richtung $v \in V$ differenzierbar ist, so ist*

$$(D_v f)(P) = 0.$$

- (2) *Wenn f in P total differenzierbar ist, so verschwindet das totale Differential, also*

$$(Df)_P = 0.$$

Beweis. (1) Zu $v \in V$ betrachten wir die Funktion

$$h: I \longrightarrow \mathbb{R}, t \longmapsto h(t) = f(P + tv),$$

wobei I ein geeignetes reelles Intervall ist. Da die Funktion f in P ein lokales Extremum besitzt, besitzt die Funktion h in $t = 0$ ein lokales Extremum. Nach Voraussetzung ist h differenzierbar und nach Satz 19.1 ist $h'(0) = 0$. Diese Ableitung stimmt aber mit der Richtungsableitung überein, also ist

$$(D_v f)(P) = h'(0) = 0.$$

- (2) folgt aus (1) aufgrund von Proposition 46.1. □

Ein lokales Extremum kann also nur in einem sogenannten kritischen Punkt einer Funktion auftreten.

DEFINITION 48.2. Sei V ein endlichdimensionaler reeller Vektorraum, $G \subseteq V$ offen und

$$f: G \longrightarrow \mathbb{R}$$

eine differenzierbare Funktion. Dann heißt $P \in G$ ein *kritischer Punkt* von f (oder ein *stationärer Punkt*), wenn

$$(Df)_P = 0$$

ist. Anderfalls spricht man von einem *regulären Punkt*.

Wir sind natürlich auch an hinreichenden Kriterien für das Vorliegen von lokalen Extrema interessiert. Wie schon im eindimensionalen Fall muss man sich die zweiten Ableitungen anschauen, wobei die Situation natürlich dadurch wesentlich verkompliziert wird, dass es zu je zwei Richtungsvektoren v und w eine zweite Richtungsableitung $D_{vw} = D_v D_w$ gibt. Die zweite Richtungsableitung wird dadurch handhabbar, dass man sie in die sogenannte Hesse-Form bzw. Hesse-Matrix zusammenfasst. Als solche ist sie eine symmetrische Bilinearform, die mit Methoden der linearen Algebra analysiert werden kann. Diese Methoden werden wir im Folgenden entwickeln und insbesondere auf die Hesse-Form anwenden, um schließlich hinreichende Kriterien für die Existenz von lokalen Extrema zu erhalten.

DEFINITION 48.3. Es sei V ein endlichdimensionaler reeller Vektorraum, $G \subseteq V$ eine offene Menge und

$$f: G \longrightarrow \mathbb{R}$$

eine zweimal stetig differenzierbare Funktion. Zu $P \in G$ heißt die Abbildung

$$\text{Hess}_P f: V \times V \longrightarrow \mathbb{R}, (u, v) \longmapsto D_u D_v f(P),$$

die *Hesse-Form* im Punkt $P \in G$.

DEFINITION 48.4. Es sei V ein endlichdimensionaler reeller Vektorraum, $G \subseteq V$ eine offene Menge und

$$f: G \longrightarrow \mathbb{R}$$

eine zweimal stetig differenzierbare Funktion. Es sei eine Basis $v_i, i = 1, \dots, n$, von V gegeben mit den zugehörigen Richtungsableitungen $D_i := D_{v_i}, i = 1, \dots, n$. Zu $P \in G$ heißt dann die Matrix

$$\begin{pmatrix} D_1 D_1 f(P) & \cdots & D_1 D_n f(P) \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ D_n D_1 f(P) & \cdots & D_n D_n f(P) \end{pmatrix}$$

die *Hesse-Matrix* zu f im Punkt P bezüglich der gegebenen Basis.

Die Hesse-Matrix ist beispielsweise die Gramsche Matrix der Hesse-Form bzgl. der Standardbasis im \mathbb{R}^n .

Eigenschaften von Bilinearformen

DEFINITION 48.5. Es sei K ein Körper, V ein endlichdimensionaler K -Vektorraum und $\langle -, - \rangle$ eine Bilinearform. Es sei v_1, \dots, v_n eine Basis von V . Dann heißt die $n \times n$ -Matrix

$$\langle v_i, v_j \rangle_{1 \leq i, j \leq n}$$

die *Gramsche Matrix* von $\langle -, - \rangle$ bezüglich dieser Basis.

LEMMA 48.6. Es sei K ein Körper, V ein endlichdimensionaler K -Vektorraum und $\langle -, - \rangle$ eine Bilinearform. Es seien $\mathbf{v} = v_1, \dots, v_n$ und $\mathbf{w} = w_1, \dots, w_n$ zwei Basen von V und es seien G bzw. H die Gramschen Matrizen von $\langle -, - \rangle$ bezüglich dieser Basen. Zwischen den Basiselementen gelten die Beziehungen

$$w_i = \sum_{j=1}^n a_{ij} v_j,$$

die wir durch die Übergangsmatrix $A = (a_{ij})_{i,j}$ ausdrücken. Dann besteht zwischen den Gramschen Matrizen die Beziehung

$$H = AGA^t.$$

Beweis. Es ist

$$\begin{aligned} \langle w_r, w_s \rangle &= \left\langle \sum_{j=1}^n a_{rj} v_j, \sum_{k=1}^n a_{sk} v_k \right\rangle \\ &= \sum_{1 \leq j, k \leq n} a_{rj} a_{sk} \langle v_j, v_k \rangle \\ &= \sum_{1 \leq j \leq n} a_{rj} \left(\sum_{1 \leq k \leq n} a_{sk} \langle v_j, v_k \rangle \right) \\ &= (A \circ G \circ A^t)_{rs}. \end{aligned}$$

□

DEFINITION 48.7. Es sei K ein Körper, V ein K -Vektorraum und $\langle -, - \rangle$ eine Bilinearform. Die Bilinearform heißt *symmetrisch*, wenn

$$\langle v, w \rangle = \langle w, v \rangle$$

für alle $v, w \in V$ gilt.

DEFINITION 48.8. Es sei V ein reeller Vektorraum mit einer symmetrischen Bilinearform $\langle -, - \rangle$. Diese Bilinearform heißt

- (1) *positiv definit*, wenn $\langle v, v \rangle > 0$ ist für alle $v \in V$, $v \neq 0$.
- (2) *negativ definit*, wenn $\langle v, v \rangle < 0$ ist für alle $v \in V$, $v \neq 0$.
- (3) *positiv semidefinit*, wenn $\langle v, v \rangle \geq 0$ ist für alle $v \in V$.
- (4) *negativ semidefinit*, wenn $\langle v, v \rangle \leq 0$ ist für alle $v \in V$.

- (5) *indefinit*, wenn $\langle -, - \rangle$ weder positiv semidefinit noch negativ semidefinit ist.

Positiv definite symmetrische Bilinearformen nennt man auch Skalarprodukte. Eine Bilinearform auf V kann man auf einen Untervektorraum $U \subseteq V$ einschränken, wodurch sich eine Bilinearform auf U ergibt. Wenn die ursprüngliche Form positiv definit ist, so überträgt sich dies auf die Einschränkung. Allerdings kann eine indefinite Form eingeschränkt auf gewisse Unterräume positiv definit werden und auf andere negativ definit. Dies führt zu folgender Definition.

DEFINITION 48.9. Es sei V ein endlichdimensionaler reeller Vektorraum mit einer symmetrischen Bilinearform $\langle -, - \rangle$. Man sagt, dass eine solche Bilinearform den *Typ*

$$(p, q)$$

besitzt, wobei

$$p := \max(\dim_{\mathbb{R}}(U), U \subseteq V, \langle -, - \rangle|_U \text{ positiv definit})$$

$$\text{und } q := \max(\dim_{\mathbb{R}}(W), W \subseteq V, \langle -, - \rangle|_W \text{ negativ definit})$$

ist.



James Joseph Sylvester (1814-1897)

Wie für Skalarprodukte nennt man zwei Vektoren $v, w \in V$ *orthogonal* bzgl. einer Bilinearform, wenn $\langle v, w \rangle = 0$ ist, und wie im Fall eines Skalarproduktes kann man zeigen, dass es Orthogonalbasen gibt. Die folgende Aussage nennt man den *Trägheitssatz von Sylvester*.

SATZ 48.10. *Es sei V ein endlichdimensionaler reeller Vektorraum mit einer symmetrischen Bilinearform $\langle -, - \rangle$ vom Typ (p, q) . Dann ist die Gramsche Matrix von $\langle -, - \rangle$ bezüglich einer jeden Orthogonalbasis eine Diagonalmatrix mit p positiven und q negativen Einträgen.*

Beweis. Bezüglich einer Orthogonalbasis u_1, \dots, u_n hat die Gramsche Matrix natürlich Diagonalgestalt. Es sei p' die Anzahl der positiven Diagonaleinträge und q' die Anzahl der negativen Diagonaleinträge. Die Basis sei so geordnet, dass die ersten p' Diagonaleinträge positiv, die folgenden q' Diagonaleinträge negativ und die übrigen 0 seien. Auf dem p' -dimensionalen Unterraum $U = \langle u_1, \dots, u_{p'} \rangle$ ist die eingeschränkte Bilinearform positiv definit, so dass $p' \leq p$ gilt. Sei $W = \langle u_{p'+1}, \dots, u_n \rangle$, auf diesem Unterraum ist die Bilinearform negativ semidefinit. Dabei ist $V = U \oplus W$, und diese beiden Räume sind orthogonal zueinander.

Angenommen, es gebe einen Unterraum U' , auf dem die Bilinearform positiv definit ist, und dessen Dimension größer als p' ist. Dann ist $U' \not\subseteq U$. Wir können annehmen, dass $U \subseteq U'$ ist, da man eine Orthogonalbasis von U zu einer Orthogonalbasis von $U + U'$ ergänzen kann, und dabei die positive Definitheit erhalten bleibt. Es gibt dann ein $u \in U'$, $u \notin U$, das orthogonal zu U ist. Daher ist $u \in W$. Dann ist aber zugleich $\langle u, u \rangle$ positiv und nicht positiv, ein Widerspruch. \square

Minorenkriterien für symmetrische Bilinearformen¹

SATZ 48.11. *Sei $\langle -, - \rangle$ eine symmetrische Bilinearform auf einem endlichdimensionalen reellen Vektorraum V und sei v_1, \dots, v_n eine Basis von V . Es sei G die Gramsche Matrix zu $\langle -, - \rangle$ bezüglich dieser Basis. Die Determinanten D_k der quadratischen Untermatrizen*

$$M_k = (\langle v_i, v_j \rangle)_{1 \leq i, j \leq k}$$

seien alle von 0 verschieden für $k = 1, \dots, n$. Es sei q die Anzahl der Vorzeichenwechsel in der Folge

$$D_0 = 1, D_1 = \det M_1, D_2 = \det M_2, \dots, D_n = \det M_n = \det G.$$

Dann ist $\langle -, - \rangle$ vom Typ $(n - q, q)$.

Beweis. Da nach Voraussetzung insbesondere die Determinante der Gramschen Matrix nicht 0 ist, ist die Bilinearform nicht ausgeartet und daher hat der Typ die Form $(n - b, b)$. Wir müssen zeigen, dass $b = q$ ist. Wir beweisen die Aussage durch Induktion über die Dimension von V , wobei der Induktionsanfang trivial ist. Die Aussage sei bis zur Dimension $n - 1$ bewiesen

¹Unter einem *Minor* versteht man die Determinante einer quadratischen Untermatrix einer Matrix. Man könnte also genauso gut von einem Determinantenkriterium sprechen.

und es liege ein n -dimensionaler Raum mit einer Basis v_1, \dots, v_n mit den angegebenen Eigenschaften vor. Der Unterraum

$$U = \langle v_1, \dots, v_{n-1} \rangle$$

hat die Dimension $n - 1$ und die Folge der Determinanten der Untermatrizen der Gramschen Matrix zur eingeschränkten Form $\langle -, - \rangle|_U$ stimmt mit der vorgegebenen Folge überein, wobei lediglich das letzte Glied

$$D_n = \det M_n = \det G$$

weggelassen wird. Nach Induktionsvoraussetzung besitzt $\langle -, - \rangle|_U$ den Typ $(n - 1 - a, a)$, wobei a die Anzahl der Vorzeichenwechsel in der Folge

$$D_0 = 1, D_1, \dots, D_{n-1}$$

ist. Aufgrund der Definition des Typs ist

$$a \leq b \leq a + 1,$$

da ein b -dimensionaler Unterraum $W \subseteq V$, auf dem die Bilinearform negativ definit ist, zu einem Unterraum $W' = U \cap W \subseteq U$ führt, der die Dimension b oder $b - 1$ besitzt und auf dem die eingeschränkte Form ebenfalls negativ definit ist. Nach Aufgabe 48.15 ist das Vorzeichen von D_{n-1} gleich $(-1)^a$ und das Vorzeichen von D_n gleich $(-1)^b$. Das bedeutet, dass zwischen D_{n-1} und D_n ein zusätzlicher Vorzeichenwechsel genau dann vorliegt, wenn

$$b = a + 1$$

ist. □

KOROLLAR 48.12. *Sei $\langle -, - \rangle$ eine symmetrische Bilinearform auf einem endlichdimensionalen reellen Vektorraum und sei v_1, \dots, v_n eine Basis von V . Es sei G die Gramsche Matrix zu $\langle -, - \rangle$ bezüglich dieser Basis und es seien D_k die Determinanten der quadratischen Untermatrizen*

$$M_k = (\langle v_i, v_j \rangle)_{1 \leq i, j \leq k}, \quad k = 1, \dots, n.$$

Dann gelten folgende Aussagen.

- (1) *Genau dann ist $\langle -, - \rangle$ positiv definit, wenn alle D_k positiv sind.*
- (2) *Genau dann ist $\langle -, - \rangle$ negativ definit, wenn das Vorzeichen in der Folge $D_0 = 1, D_1, D_2, \dots, D_n$ an jeder Stelle wechselt.*

Beweis. (1). Wenn die Bilinearform positiv definit ist, so ist nach Aufgabe 48.15 das Vorzeichen der Determinante der Gramschen Matrix gleich $(-1)^0 = 1$, also positiv. Da die Einschränkung der Form auf die Unterräume $U_i = \langle v_1, \dots, v_i \rangle$ ebenfalls positiv definit ist, sind auch die Determinanten zu den Untermatrizen positiv. Wenn umgekehrt die Determinanten alle positiv sind, so folgt aus Satz 48.11, dass die Bilinearform positiv definit ist. (2) folgt aus (1), indem man die negative Bilinearform, also $-\langle -, - \rangle$, betrachtet. □

Abbildungsverzeichnis

Quelle = James Joseph Sylvester.jpg , Autor = nicht bekannt, Lizenz =
PD 4