

Cvičení 11.2.

Lokální vázané extrémy

VĚTA. (METODA LAGRANGEOVÝCH MULTIPLIKÁTORŮ – nutná podmínka pro extrém)

Nechť jsou funkce $f(\mathbf{x})$ a $g(\mathbf{x})$ diferencovatelné na otevřené množině $M \subset \mathbb{R}^n$ a pro každé $\mathbf{x} \in M$ je $\|\operatorname{grad} g(\mathbf{x})\| \neq 0$. Jestliže má funkce $f(\mathbf{x})$ na množině $g(\mathbf{x}) = 0$ v bodě \mathbf{a} lokální extrém, existuje reálné číslo λ takové, že $df(\mathbf{a}, d\mathbf{x}) + \lambda dg(\mathbf{a}, d\mathbf{x}) = 0$.

Jestliže defunujeme Lagrangeovu funkci

$$L(\mathbf{x}) = f(\mathbf{x}) + \lambda g(\mathbf{x})$$

lze uvedenou podmínu zapsat jako $dL(\mathbf{a}, d\mathbf{x}) = 0$ neboli

$$\frac{\partial L}{\partial x_i}(\mathbf{a}) = 0 \quad \text{pro každé } i = 1, 2, \dots, n.$$

VĚTA. (METODA LAGRANGEOVÝCH MULTIPLIKÁTORŮ – postačující podmínka pro extrém)

Nechť mají funkce $f(\mathbf{x})$ a $g(\mathbf{x})$ na otevřené množině $M \subset \mathbb{R}^n$ druhý diferenciál a pro každé $\mathbf{x} \in M$ je $\|\operatorname{grad} g(\mathbf{x})\| \neq 0$. a v bodě \mathbf{a} jsou splněny nutné podmínky pro lokální extrém funkce $f(\mathbf{x})$ na množině $g(\mathbf{x}) = 0$. Jestliže je kvadratická forma $d^2L(\mathbf{a}, d\mathbf{x})$ na množině $dg(\mathbf{a}, d\mathbf{x}) = 0$

pozitivně definitní má funkce $f(\mathbf{x})$ na množině $g(\mathbf{x}) = 0$ v bodě \mathbf{a} lokální minimum
negativně definitní má funkce $f(\mathbf{x})$ na množině $g(\mathbf{x}) = 0$ v bodě \mathbf{a} lokální maximum
indefinitní nemá funkce $f(\mathbf{x})$ na množině $g(\mathbf{x}) = 0$ v bodě \mathbf{a} lokální extrém

VĚTA. (METODA LAGRANGEOVÝCH MULTIPLIKÁTORŮ – nutná podmínka pro extrém)

Nechť jsou funkce $f(\mathbf{x})$ a $g_k(\mathbf{x})$, $k = 1, 2, \dots, r < n$, diferencovatelné na otevřené množině $M \subset \mathbb{R}^n$ a pro každé $\mathbf{x} \in M$ je hodnost matice

$$\mathbf{g}'(\mathbf{x}) = \begin{pmatrix} \frac{\partial g_1}{\partial x_1} & \frac{\partial g_1}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial g_1}{\partial x_n} \\ \frac{\partial g_2}{\partial x_1} & \frac{\partial g_2}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial g_2}{\partial x_n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \frac{\partial g_r}{\partial x_1} & \frac{\partial g_r}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial g_r}{\partial x_n} \end{pmatrix} (\mathbf{x})$$

rovna r . Jestliže má funkce $f(\mathbf{x})$ na množině $g_k(\mathbf{x}) = 0$, kde $k = 1, 2, \dots, r$, v bodě \mathbf{a} lokální extrém, existují reálná čísla $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_r$ taková, že

$$df(\mathbf{a}, d\mathbf{x}) + \sum_{k=1}^r \lambda_k dg_k(\mathbf{a}, d\mathbf{x}) = 0.$$

Jestliže defunujeme Lagrangeovu funkci

$$L(\mathbf{x}) = f(\mathbf{x}) + \sum_{k=1}^r \lambda_k g_k(\mathbf{x})$$

lze uvedenou podmínu zapsat jako $dL(\mathbf{a}, d\mathbf{x}) = 0$ neboli

$$\frac{\partial L}{\partial x_i}(\mathbf{a}) = 0 \quad \text{pro každé } i = 1, 2, \dots, n.$$

VĚTA. (METODA LAGRANGEOVÝCH MULTIPLIKÁTORŮ – postačující podmínka pro extrém)

Nechť mají funkce $f(\mathbf{x})$ a $g_k(\mathbf{x})$, $k = 1, 2, \dots, r < n$, na otevřené množině $M \subset \mathbb{R}^n$ druhý diferenciál a pro každé $\mathbf{x} \in M$ je hodnost matice

$$\mathbf{g}'(\mathbf{x}) = \begin{pmatrix} \frac{\partial g_1}{\partial x_1} & \frac{\partial g_1}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial g_1}{\partial x_n} \\ \frac{\partial g_2}{\partial x_1} & \frac{\partial g_2}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial g_2}{\partial x_n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \frac{\partial g_r}{\partial x_1} & \frac{\partial g_r}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial g_r}{\partial x_n} \end{pmatrix} (\mathbf{x})$$

rovna r a v bodě \mathbf{a} jsou splněny nutné podmínky pro lokální extrém funkce $f(\mathbf{x})$ na množině $g_k(\mathbf{x}) = 0$, kde $k = 1, 2, \dots, r$. Jestliže je kvadratická forma $d^2L(\mathbf{a}, d\mathbf{x})$ na množině $dg_k(\mathbf{a}, d\mathbf{x}) = 0$, kde $k = 1, 2, \dots, r$,

pozitivně definitní má funkce $f(\mathbf{x})$ na množině $g_k(\mathbf{x}) = 0$, $k = 1, \dots, r$, v bodě \mathbf{a} lokální minimum
negativně definitní má funkce $f(\mathbf{x})$ na množině $g_k(\mathbf{x}) = 0$, $k = 1, \dots, r$, v bodě \mathbf{a} lokální maximum
indefinitní nemá funkce $f(\mathbf{x})$ na množině $g_k(\mathbf{x}) = 0$, $k = 1, \dots, r$, v bodě \mathbf{a} lokální extrém

ŘEŠENÉ PŘÍKLADY

Příklad 1.r. Najděte lokální extrémy funkce $f(x, y) = x^2 + 12xy + 2y^2$ za podmínky $4x^2 + y^2 = 25$.

ŘEŠENÍ: Protože se jedná o vázaný extrém, zavedeme Lagrangeovu funkci

$$L(x, y) = f(x, y) + \lambda g(x, y) = x^2 + 12xy + 2y^2 + \lambda(4x^2 + y^2 - 25).$$

Protože

$$\frac{\partial L}{\partial x} = 2x + 12y + 8\lambda x = (2 + 8\lambda)x + 12y, \quad \frac{\partial L}{\partial y} = 12x + 4y + 2\lambda x = 12x + (4 + 2\lambda)y,$$

jsou nutné podmínky pro extrém

$$(1 + 4\lambda)x + 6y = 0, \quad 6x + (2 + \lambda)y = 0, \quad 4x^2 + y^2 = 25. \quad (1)$$

Z první rovnice dostaneme

$$y = -\frac{1}{6}(1 + 4\lambda)x$$

a když tento výraz dosadíme do druhé rovnice, zjistíme, že musí platit

$$((2 + \lambda)(1 + 4\lambda) - 36)x = (4\lambda^2 + 9\lambda - 34)x = 0.$$

Je-li $x = 0$, je také $y = 0$, ale tento bod nesplňuje podmítku $4x^2 + y^2 = 25$. Proto musí být

$$4\lambda^2 + 9\lambda - 34 = 0, \quad \text{tj.} \quad \lambda_1 = 2, \quad \lambda_2 = -\frac{17}{4}.$$

Pro $\lambda = 2$ jsou první dvě rovnice v (1)

$$9x + 6y = 0, \quad 6x + 4y = 0,$$

a tedy jsou lineárně závislé. Jejich obecné řešení je $x = 2t$, $y = -3t$, kde $t \in \mathbb{R}$. Jestliže dosadíme toto vyjádření x a y do podmítky $4x^2 + y^2 = 25$, dostaneme rovnici $t^2 = 1$, tj.

$t = \pm 1$. Pro $\lambda = 2$ jsme tedy našli dva body $\mathbf{a}_1 = [2, -3]$ a $\mathbf{a}_2 = [-2, 3]$, ve kterých může být lokální vázaný extrém.

Pro $\lambda = -\frac{17}{4}$ vedou první dvě rovnice v (1) na soustavu

$$-16x + 6y = 0, \quad 6x - \frac{9}{4}y = 0,$$

ve které jsou obě rovnice lineárně závislé. Obecné řešení této soustavy je $x = 3t$, $y = 8t$, kde $t \in \mathbb{R}$. Po dosazení do vazbové podmínky $4x^2 + y^2 = 25$, dostaneme pro t rovnici $t^2 = \frac{1}{4}$, tj. $t = \pm \frac{1}{2}$. Pro $\lambda = -\frac{17}{4}$ máme tedy další dva body $\mathbf{a}_3 = [\frac{3}{2}, 4]$ a $\mathbf{a}_4 = [-\frac{3}{2}, -4]$, ve kterých může mít funkce $f(x, y)$ vázaný extrém.

Protože druhé parciální derivace Lagrangeovy funkce jsou

$$\frac{\partial^2 L}{\partial x^2} = 2 + 8\lambda, \quad \frac{\partial^2 L}{\partial x \partial y} = 12, \quad \frac{\partial^2 L}{\partial y^2} = 4 + 2\lambda,$$

je druhý diferenciál Lagrangeovy funkce

$$d^2L = (2 + 8\lambda) dx^2 + 24 dx dy + (4 + 2\lambda) dy^2.$$

Speciálně pro $\lambda = 2$ je

$$d^2L = 18 dx^2 + 24 dx dy + 8 dy^2 = 2(3 dx + 2 dy)^2$$

a pro $\lambda = -\frac{17}{4}$ dostaneme

$$d^2L = -32 dx^2 + 24 dx dy - \frac{9}{2} dy^2 = -\frac{1}{2}(8 dx - 3 dy)^2.$$

V obou případech je druhý diferenciál Lagrangeovy funkce pouze semidefinitní. Ale z vazbové podmínky dostaneme pro proměnné dx a dy vztah

$$dg(x, y) = 8x dx + 2y dy = 0.$$

Pro $\lambda = 2$ splňují x a y rovnici $3x + 2y = 0$ a proto platí $dy = \frac{8}{3}dx$. Tedy v tomto případě nás zajímá kvadratická forma jedné proměnné $\Phi = 2(\frac{25}{3})^2 dx^2$, která je pozitivně definitní. Proto má funkce $f(x, y)$ na elipse $4x^2 + y^2 = 25$ v bodech $\mathbf{a}_1 = [2, -3]$ a $\mathbf{a}_2 = [-2, 3]$ lokální minimum.

Pro $\lambda = -\frac{17}{4}$ splňují x a y rovnici $8x - 3y = 0$ a proto platí $dy = -\frac{3}{2}dx$. Tedy v tomto případě nás zajímá kvadratická forma jedné proměnné $\Phi = -\frac{1}{2}(\frac{25}{2})^2 dx^2$, která je negativně definitní. Proto má funkce $f(x, y)$ na elipse $4x^2 + y^2 = 25$ v bodech $\mathbf{a}_3 = [\frac{3}{2}, 4]$ a $\mathbf{a}_4 = [-\frac{3}{2}, -4]$ lokální maximum.

Příklad 2.r. Najděte lokální extrémy funkce $f(x, y, z) = xy^2z^3$ za podmínky $x+y+z = 1$, $x, y, z > 0$.

ŘEŠENÍ: Jedná se o vázaný extrém, ale podmínka je velmi jednoduchá. Proto nepoužijeme metodu Lagrangeových multiplikátorů, ale podmínu vyřešíme. Nejjednodušší bude vyjádřit $x = 1 - y - z$. Po dosazení do funkce $f(x, y, z)$ dostaneme funkci dvou proměnných

$$F(y, z) = (1 - y - z)y^2z^3.$$

Podmínky $x, y, z > 0$ pak vedou na podmínky pro $y > 0, z > 0$ a $y+z < 1$. Budeme tedy hledat lokální extrémy funkce $F(y, z)$ na otevřeném trojúhelníku $y > 0, z > 0$ a $y+z < 1$. Protože se jedná o lokální extrémy funkce na otevřené množině, jsou nutné podmínky pro extrém

$$\begin{aligned}\frac{\partial F}{\partial y} &= -y^2 z^3 + 2yz^3(1-y-z) = yz^3(2-3y-2z) = 0, \\ \frac{\partial F}{\partial z} &= -y^2 z^3 + 3y^2 z^2(1-y-z) = y^2 z^2(3-3y-4z) = 0.\end{aligned}$$

Protože $y, z > 0$ plyne z těchto podmínek soustava rovnic

$$3y + 2z = 2, \quad 3y + 4z = 3 \implies y = \frac{1}{2}, \quad z = \frac{1}{3}.$$

Protože pro tyto hodnoty platí $y+z = \frac{5}{6} < 1$ našli jsme bod $\mathbf{a} = [\frac{1}{2}, \frac{1}{3}]$, ve kterém může mít funkce $F(y, z)$ lokální extrém.

O jeho typu rozhodneme pomocí druhého diferenciálu $d^2F(\mathbf{a}, \mathbf{h})$. Protože

$$\begin{aligned}F''_{,yy} &= z^3(2-3y-2z) - 3yz^3, \\ F''_{,yz} &= 3yz^2(2-3y-2z) - 2yz^3, \\ F''_{,zz} &= 2y^2 z(3-3y-4z) - 4y^2 z^2,\end{aligned}$$

je matice \mathbf{A} , která odpovídá kvadratické formě $d^2F(\mathbf{a}, \mathbf{h})$ rovna

$$\mathbf{A} = \begin{pmatrix} -\frac{1}{8}, & -\frac{1}{12} \\ -\frac{1}{12}, & -\frac{1}{9} \end{pmatrix}$$

A protože $D_1 = -\frac{1}{8} < 0$ a $D_2 = \frac{1}{72} - \frac{1}{144} > 0$, je kvadratická forma $d^2F(\mathbf{a}, \mathbf{h})$ negativně definitní. Tedy v bodě \mathbf{a} má funkce $F(y, z)$ lokální maximum.

Protože $x = 1 - y - z$ má funkce $f(x, y, z)$ na množině $x + y + z = 1$ v bodě $[\frac{1}{6}, \frac{1}{3}, \frac{1}{2}]$ lokální maximum.

Příklad 3.r. Najděte lokální extrémy funkce $z = z(x, y)$, která je dána jako řešení rovnice

$$x^2 + y^2 + z^2 - xz - yz + 2x + 2y + 2z + 2 = 0. \quad (2)$$

ŘEŠENÍ: Ukážeme dvě metody řešení dané úlohy. V první budeme předpokládat, že je rovnicí (2) implicitně definována funkce $z = z(x, y)$ a ve druhé budeme pomocí Lagrangeových multiplikátorů hledat lokální extrémy funkce $f(x, y, z) = z$ za podmínky (2).

Když předpokládáme, že je rovnicí (2) implicitně definována funkce $z = z(x, y)$, platí pro její parciální derivace vztahy

$$\begin{aligned}2x + 2zz'_{,x} - z - xz'_{,x} - yz'_{,x} + 2 + 2z'_{,x} &= 2x - z + 2 + (2z - x - y + 2)z'_{,x} = 0, \\ 2y + 2zz'_{,y} - xz'_{,y} - z - yz'_{,y} + 2 + 2z'_{,y} &= 2y - z + 2 + (2z - x - y + 2)z'_{,y} = 0.\end{aligned}$$

Protože hledáme lokální extrémy funkce $z = z(x, y)$, budou nás zajímat body, ve kterých je $z'_{,x} = z'_{,y} = 0$. Pro takové body musí platit

$$2x - z + 2 = 0, \quad 2y - z + 2 = 0$$

a rovnice (2). Z předcházející soustavy rovnic plyne $y = x$ a $z = 2x + 2$. Jestliže dosadíme do (2), dostaneme pro x kvadratickou rovnici $x^2 + 6x + 5 = 0$, která má řešení $x_1 = -1$ a $x_2 = -5$. Tak jsme získali dva body $\mathbf{a}_1 = [-1, -1, 0]$ a $\mathbf{a}_2 = [-5, -5, -8]$, ve kterých může být extrém.

Abychom našli jeho typ, měli bychom ještě najít druhý diferenciál funkce $z = z(x, y)$ v těchto bodech. Pro druhé parciální derivace získáme soustavu rovnic

$$\begin{aligned} 2 - z'_{,x} + (2z'_{,x} - 1)z'_{,x} + (2z - x - y + 2)z''_{,xx} &= 0, \\ -z'_{,y} + (2z'_{,y} - 1)z'_{,x} + (2z - x - y + 2)z''_{,xy} &= 0, \\ 2 - z'_{,y} + (2z'_{,y} - 1)z'_{,y} + (2z - x - y + 2)z''_{,yy} &= 0. \end{aligned}$$

Druhý diferenciál hledáme v bodech $\mathbf{a}_1 = [-1, -1, 0]$ a $\mathbf{a}_2 = [-5, -5, -8]$. V obou těchto bodech je $z'_{,x} = z'_{,y} = 0$.

V bodě \mathbf{a}_1 dostaneme

$$2 + 4z''_{,xx} = 0, \quad z''_{xy} = 0, \quad 2 + 4z''_{,yy} = 0.$$

Tedy v tomto bodě je

$$d^2z(\mathbf{a}_1, \mathbf{h}) = -\frac{1}{2}(h_1^2 + h_2^2).$$

Jedná se proto o negativně definitní kvadratickou formu a proto má funkce $z = z(x, y)$ v bodě $\mathbf{a}_1 = [-1, -1, 0]$ lokální maximum.

V bodě \mathbf{a}_2 dostaneme

$$2 - 4z''_{,xx} = 0, \quad z''_{xy} = 0, \quad 2 - 4z''_{,yy} = 0.$$

Tedy v tomto bodě je

$$d^2z(\mathbf{a}_2, \mathbf{h}) = \frac{1}{2}(h_1^2 + h_2^2).$$

Jedná se proto o pozitivně definitní kvadratickou formu a proto má funkce $z = z(x, y)$ v bodě $\mathbf{a}_2 = [-5, -5, -8]$ lokální minimum.

Když budeme příklad řešit tak, že budeme hledat lokální extrém funkce $f(x, y, z) = z$ za podmínky (2), sestrojíme nejprve Lagrangeovu funkci

$$L(x, y, z) = f(x, y, z) + \lambda g(x, y, z) = z + \lambda(x^2 + y^2 + z^2 - xz - yz + 2x + 2y + 2z + 2).$$

Nutné podmínky pro lokální extrém nyní jsou

$$\frac{\partial L}{\partial x} = \lambda(2x - z + 2) = 0, \quad \frac{\partial L}{\partial y} = \lambda(2y - z + 2) = 0, \quad \frac{\partial L}{\partial z} = 1 + \lambda(2z - x - y + 2) = 0$$

a vazbová podmínka (2). Ze třetí rovnice plyne, že $\lambda \neq 0$ a pro x, y a z dostaneme tedy stejnou soustavu rovnic jako v první metodě. Navíc pro bod $\mathbf{a}_1 = [-1, -1, 0]$ dostaneme ze třetí rovnice $\lambda_1 = -\frac{1}{4}$ a pro bod $\mathbf{a}_2 = [-5, -5, -8]$ získáme $\lambda_2 = \frac{1}{4}$.

Druhé parciální derivace Lagrangeovy funkce $L(x, y, z)$ jsou

$$L''_{,xx} = 2\lambda, \quad L''_{,xy} = 0, \quad L''_{,xz} = -\lambda, \quad L''_{,yy} = 2\lambda, \quad L''_{,yz} = -\lambda, \quad L''_{,zz} = 2\lambda.$$

Tedy druhý diferenciál Lagrangeovy funkce je

$$d^2L = 2\lambda(dx^2 - dx dz + dy^2 - dy dz + dz^2).$$

Ten je pozitivně definitní pro $\lambda = \frac{1}{4} > 0$ a negativně definitní pro $\lambda = -\frac{1}{4}$.

Opět jsme dostali, že funkce $z = z(x, y)$ definovaná rovnicí (2) má lokální maximum v bodě $\mathbf{a}_1 = [-1, -1, 0]$ a lokální minimum v bodě $\mathbf{a}_2 = [-5, -5, -8]$.

NEŘEŠENÉ PŘÍKLADY

Příklad 1. Najděte lokální extrémy funkce $f(x, y) = x^2 + 2y^2$ za podmínky $x^2 - 2x + 2y^2 + 4y = 0$.

$$\left[\begin{array}{l} \text{v bodě } [0; 0] \text{ je lokální minimum,} \\ \text{v bodě } [2; -2] \text{ je lokální maximum.} \end{array} \right]$$

Příklad 2. Najděte lokální extrémy funkce $f(x, y) = xy$ za podmínky $x^2 - 3xy + y^2 = 20$.

$$\left[\begin{array}{l} \text{v bodech } [2; -2] \text{ a } [-2; 2] \text{ jsou lokální minima.} \end{array} \right]$$

Příklad 3. Najděte lokální extrémy funkce $f(x, y) = xy$ za podmínky $x^2 + 5xy + 4y^2 = 18$.

$$\left[\begin{array}{l} \text{v bodech } [2; 1] \text{ a } [-2; -1] \text{ jsou lokální maxima.} \end{array} \right]$$

Příklad 4. Najděte lokální extrémy funkce $f(x, y) = xy$ za podmínky $\frac{2}{x} + \frac{3}{y} = 1$.

$$\left[\begin{array}{l} \text{v bodě } [4; 6] \text{ je lokální minimum.} \end{array} \right]$$

Příklad 5. Najděte lokální extrémy funkce $f(x, y, z) = x - 2y + 2z$ za podmínky $x^2 + y^2 + z^2 = 1$.

$$\left[\begin{array}{l} \text{v bodě } [\frac{1}{3}; -\frac{2}{3}; \frac{2}{3}] \text{ je lokální maximum,} \\ \text{v bodě } [-\frac{1}{3}; \frac{2}{3}; -\frac{2}{3}] \text{ je lokální minimum.} \end{array} \right]$$

Příklad 6. Najděte lokální extrémy funkce $f(x, y, z) = xyz$ za podmínky $x + y + z = 3$.

$$\left[\begin{array}{l} \text{v bodě } [1; 1; 1] \text{ je lokální maximum,} \\ \text{v bodech } [3; 0; 0], [0; 3; 0] \text{ a } [0; 0; 3] \text{ nejsou lokální extrémy.} \end{array} \right]$$

Příklad 7. Najděte lokální extrémy funkce $f(x, y, z) = xy + xz + yz$ za podmínky $xyz = 1$.

$$\left[\begin{array}{l} \text{v bodě } [1; 1; 1] \text{ je lokální minimum.} \end{array} \right]$$

Příklad 8. Najděte lokální extrémy funkce $y = y(x)$, která je dána jako řešení rovnice $x^2 - xy + y^2 - 2x + 4y + 1 = 0$.

$$\left[\begin{array}{l} \text{v bodě } x = 1 \text{ je lokální maximum } y = 0, \\ \text{v bodě } x = -1 \text{ je lokální minimum } y = -4. \end{array} \right]$$

Příklad 9. Najděte lokální extrémy funkce $y = y(x)$, která je dána jako řešení rovnice $x^3 + y^3 - 3xy = 0$.

$$\left[\begin{array}{l} \text{v bodě } x = \sqrt[3]{2} \text{ je lokální maximum } y = \sqrt[3]{4}, \\ \text{v okolí bodu } [0; 0] \text{ není funkce } y = y(x) \text{ rovnicí definována.} \end{array} \right]$$

Příklad 10. Najděte lokální extrémy funkce $z = z(x, y)$, která je dána jako řešení rovnice $2x^2 + 2y^2 + z^2 + 4xz + 4y - z + 4 = 0$.

$$\left[\begin{array}{l} \text{v bodě } [-1, -1] \text{ je lokální maximum } z = 1, \\ \text{v bodě } [2; -1] \text{ je lokální minimum } z = -4. \end{array} \right]$$