



Facoltà di Scienze Matematiche, Fisiche e Naturali
 Corso di Laurea in Matematica

Istituzioni di Analisi Superiore, secondo modulo

Prova Scritta del 15 aprile 1999

Svolgimento

1. Dire che per ogni $t \in X$ la funzione $y \mapsto f(t, y)$ è differenziabile significa che per ogni $t \in X$ e $y_0 \in Y$ esiste un'applicazione lineare continua $L_{t,y_0}: Y \rightarrow Y$ tale che

$$\lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(t, y_0 + h) - f(t, y_0) - L_{t,y_0}(h)}{\|h\|} = 0.$$

Useremo la notazione $L_{t,y_0}(h) =: \partial_y f(t, y_0)[h]$. Dire che $y \mapsto f(t, y)$ è differenziabile “con continuità” significa che per ogni $t \in X$ l'applicazione $y_0 \mapsto L_{t,y_0}$ è continua come funzione da Y nello spazio degli operatori lineari continui $Y \rightarrow Y$ con la norma operatoriale. Nel caso particolare in cui $Y = \mathbb{R}^n$, “differenziabile con continuità” equivale a dire che per ogni $t \in X$ esistono le derivate parziali delle componenti di f

$$\frac{\partial f_i}{\partial y_j}(t, y_1, \dots, y_n)$$

e che sono funzioni continue della n -upla $(y_1, \dots, y_n) \in \mathbb{R}^n$.

- a. Sappiamo che il differenziale di una funzione calcolato nell'incremento h coincide con la *derivata direzionale* della funzione in quella direzione. Quindi per ogni $t \in X, y_0, h \in Y$ abbiamo

$$\partial_y f(t, y_0)[h] = \lim_{\theta \rightarrow 0} \frac{f(t, y_0 + \theta h) - f(t, y_0)}{\theta}.$$

Calcoliamo il limite lungo una qualsiasi successione θ_n che tenda a 0 senza mai annullarsi, per esempio $\theta_n := 1/n$:

$$\partial_y f(t, y_0)[h] = \lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{f(t, y_0 + h/n) - f(t, y_0)}{1/n}.$$

Poniamo

$$g_n(t, y_0, h) := \frac{f(t, y_0 + h/n) - f(t, y_0)}{1/n}.$$

Per ogni y_0, h fissati, la funzione a valori reali $t \mapsto g_n(t, y_0, h)$ è \mathcal{M} -misurabile perché combinazione lineare delle funzioni misurabili per ipotesi $t \mapsto f(t, y_0 + h/n)$ e $t \mapsto f(t, y_0)$. Dunque per ogni y_0, h fissati la funzione

$$t \mapsto \partial_y f(t, y_0)[h] = \lim_{n \rightarrow +\infty} g_n(t, y_0, h)$$

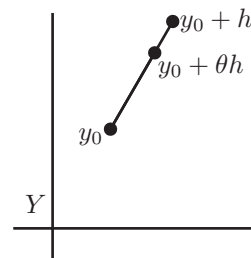
è \mathcal{M} -misurabile perché limite puntuale di una successione di funzioni misurabili.

- b. Per ogni $t \in X, y_0, h \in Y$ la funzione di variabile reale

$$\theta \mapsto \varphi(\theta) := f(t, y_0 + \theta h)$$

è composizione delle due funzioni $\theta \mapsto y_0 + \theta h$ e $y \mapsto f(t, y)$, entrambe differenziabili per ipotesi. Per la regola del differenziale delle funzioni composte la φ è derivabile e

$$\varphi'(\theta) = \frac{\partial}{\partial \theta} f(t, y_0 + \theta h) = \partial_y f(t, y_0 + \theta h)[h].$$



L'ultimo membro dell'uguaglianza è una funzione continua di θ , in quanto composizione delle funzioni continue $\theta \mapsto y_0 + \theta h$ e $y \mapsto \partial_y f(t, y)[h]$. Quindi la funzione $\theta \mapsto f(t, y_0 + \theta h)$ ha derivata continua, e possiamo applicare il teorema fondamentale del calcolo:

$$f(t, y_0 + h) - f(t, y_0) = \varphi(1) - \varphi(0) = \int_0^1 \varphi'(\theta) d\theta = \int_0^1 \partial_y f(t, y_0 + \theta h)[h] d\theta.$$

Sotto il segno di integrale aggiungiamo e togliamo la quantità $\partial_y f(t, y_0)[h]$, che non dipende da θ :

$$\begin{aligned} f(t, y_0 + h) - f(t, y_0) &= \int_0^1 \left(\partial_y f(t, y_0 + \theta h)[h] - \partial_y f(t, y_0)[h] \right) d\theta + \int_0^1 \partial_y f(t, y_0)[h] d\theta = \\ &= \int_0^1 \left(\partial_y f(t, y_0 + \theta h)[h] - \partial_y f(t, y_0)[h] \right) d\theta + \partial_y f(t, y_0)[h]. \end{aligned}$$

Per ipotesi per ogni $y_0, h \in Y$ le tre funzioni $t \mapsto f(t, y_0 + h)$, $t \mapsto f(t, y_0)$ e $t \mapsto \partial_y f(t, y_0)[h]$ sono in $L^1(\mu)$. Quindi anche la funzione

$$t \mapsto \int_0^1 \left(\partial_y f(t, y_0 + \theta h)[h] - \partial_y f(t, y_0)[h] \right) d\theta = f(t, y_0 + h) - f(t, y_0) - \partial_y f(t, y_0)[h]$$

è in $L^1(\mu)$. Integrandola su X si ottiene

$$\int_X \left(\int_0^1 \left(\partial_y f(t, y_0 + \theta h)[h] - \partial_y f(t, y_0)[h] \right) d\theta \right) d\mu(t) = F(y_0 + h) - F(y_0) - \int_X \partial_y f(t, y_0)[h] d\mu(t),$$

cioè la formula richiesta.

c. L'applicazione

$$L_{y_0}(h) := \int_X \partial_y f(t, y_0)[h] d\mu(t)$$

è ovviamente lineare da Y in \mathbb{R} . Vediamo se è continua: per $y_0 \in U$ possiamo scrivere

$$\|\partial_y f(t, y_0)[h]\| \leq \|\partial_y f(t, y_0)\| \cdot \|h\| \leq \|h\| \cdot \sup_{y \in U} \|\partial_y f(t, y)\|,$$

da cui

$$|L_{y_0}(h)| = \left| \int_X \partial_y f(t, y_0)[h] d\mu(t) \right| \leq \int_X |\partial_y f(t, y_0)[h]| d\mu(t) \leq \|h\| \cdot \underbrace{\int_X \left(\sup_{y \in U} \|\partial_y f(t, y)\| \right) d\mu(t)}_{< +\infty}.$$

Dunque $L_{y_0}: Y \rightarrow \mathbb{R}$ è davvero continua, ed è una candidata ad essere il differenziale di $y \mapsto F(y)$. Prendiamo una successione $h_n \rightarrow 0$ mai nulla e vediamo se la quantità

$$\frac{F(y_0 + h_n) - F(y_0) - L_{y_0}(h_n)}{\|h_n\|}$$

è infinitesima. Per il punto precedente questa quantità coincide con

$$\begin{aligned} \frac{1}{\|h_n\|} \int_X \left(\int_{[0,1]} \left(\partial_y f(t, y_0 + \theta h_n)[h_n] - \partial_y f(t, y_0)[h_n] \right) d\theta \right) d\mu(t) = \\ = \int_X \left(\int_{[0,1]} \left(\partial_y f(t, y_0 + \theta h_n) - \partial_y f(t, y_0) \right) \left[\frac{h_n}{\|h_n\|} \right] d\theta \right) d\mu(t). \end{aligned}$$

Poniamo

$$\psi_n(\theta, t) := (\partial_y f(t, y_0 + \theta h_n) - \partial_y f(t, y_0)) \left[\frac{h_n}{\|h_n\|} \right],$$

di modo che

$$\frac{F(y_0 + h_n) - F(y_0) - L_{y_0}(h_n)}{\|h_n\|} = \int_X \left(\int_{[0,1]} \psi_n(\theta, t) d\theta \right) d\mu(t).$$

Vogliamo dimostrare che questa quantità è infinitesima usando la convergenza dominata. Purtroppo non è chiarissimo se la funzione $(\theta, t) \mapsto \psi_n(\theta, t)$ sia misurabile rispetto allo spazio prodotto fra i misurabili secondo Lebesgue di $[0, 1]$ ed \mathcal{M} (punto da indagare per ulteriore **esercizio**). Quindi ci rassegnamo a lasciare l'integrale in forma iterata e applicare la convergenza dominata due volte. Per $t \in X$ fissato, per ipotesi la funzione $y \mapsto \partial_y f(t, y)$ è continua rispetto alla norma operatoriale. Poiché $y_0 + \theta h_n \rightarrow y_0$ per $n \rightarrow +\infty$ per ogni $\theta \in [0, 1]$,

$$\begin{aligned} |\psi_n(\theta, t)| &= \left| (\partial_y f(t, y_0 + \theta h_n) - \partial_y f(t, y_0)) \left[\frac{h_n}{\|h_n\|} \right] \right| \leq \\ &\leq \|\partial_y f(t, y_0 + \theta h_n) - \partial_y f(t, y_0)\| \cdot \left\| \frac{h_n}{\|h_n\|} \right\| = \\ &= \|\partial_y f(t, y_0 + \theta h_n) - \partial_y f(t, y_0)\| \longrightarrow 0 \quad \text{per } n \rightarrow +\infty \quad \forall \theta \in [0, 1]. \end{aligned}$$

Dato che U è un intorno di y_0 , per n abbastanza grande $y_0 + h_n$ appartiene a U , e visto che U è anche convesso, per ogni $\theta \in [0, 1]$ anche $y_0 + \theta h_n \in U$. Dunque per n grande e $\theta \in [0, 1]$ possiamo maggiorare

$$|\psi_n(\theta, t)| \leq \|\partial_y f(t, y_0 + \theta h_n) - \partial_y f(t, y_0)\| \leq 2 \sup_{y \in U} \|\partial_y f(t, y)\|.$$

Per μ -quasi ogni $t \in X$ l'ultimo membro è un numero reale finito, indipendente da n . Per il teorema della convergenza dominata applicato all'integrale di Lebesgue rispetto a θ quindi

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \int_{[0,1]} \psi_n(\theta, t) d\theta = \int_{[0,1]} \left(\lim_{n \rightarrow +\infty} \psi_n(\theta, t) \right) d\theta = 0 \quad \text{per quasi ogni } t \in X.$$

Posto

$$\xi_n(t) := \int_{[0,1]} \psi_n(\theta, t) d\theta,$$

abbiamo che ξ_n è in $L^1(\mu)$ per quanto già detto, $\xi_n(t) \rightarrow 0$ per $n \rightarrow +\infty$ per μ -quasi ogni $t \in X$, e inoltre

$$|\xi_n(t)| \leq \int_{[0,1]} |\psi_n(\theta, t)| d\theta \leq 1 \cdot 2 \sup_{y \in U} \|\partial_y f(t, y)\|.$$

Quest'ultimo membro non dipende da n e per ipotesi è in $L^1(\mu)$. Dunque, di nuovo per il teorema della convergenza dominata, questa volta rispetto alla misura μ ,

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{F(y_0 + h_n) - F(y_0) - L_{y_0}(h_n)}{\|h_n\|} = \lim_{n \rightarrow +\infty} \int_X \xi_n d\mu = \int_X \left(\lim_{n \rightarrow +\infty} \xi_n \right) d\mu = 0,$$

come volevasi dimostrare. Manca solo da verificare che il differenziale di F è continuo, cioè che la funzione $y_0 \mapsto \partial_y F(y_0)$ è continua da U nello spazio degli operatori lineari $Y \rightarrow \mathbb{R}$. Sia $y_n \in U$ una successione che converge a $\bar{y} \in U$. Vogliamo dimostrare che la quantità

$$\|\partial_y F(y_n) - \partial_y F(\bar{y})\| = \sup_{\substack{h \in Y \\ \|h\| \leq 1}} \left| \partial_y F(y_n)[h] - \partial_y F(\bar{y})[h] \right|$$

è infinitesima per $n \rightarrow +\infty$. Esplicitiamo le $\partial_y F$:

$$\begin{aligned} \sup_{\substack{h \in Y \\ \|h\| \leq 1}} \left| \partial_y F(y_n)[h] - \partial_y F(\bar{y})[h] \right| &= \sup_{\substack{h \in Y \\ \|h\| \leq 1}} \left| \int_X \partial_y f(t, y_n)[h] d\mu(t) - \int_X \partial_y f(t, \bar{y})[h] d\mu(t) \right| = \\ &= \sup_{\substack{h \in Y \\ \|h\| \leq 1}} \left| \int_X (\partial_y f(t, y_n) - \partial_y f(t, \bar{y}))[h] d\mu(t) \right| \leq \\ &\leq \sup_{\substack{h \in Y \\ \|h\| \leq 1}} \int_X |(\partial_y f(t, y_n) - \partial_y f(t, \bar{y}))[h]| d\mu(t) \leq \\ &\leq \int_X \|\partial_y f(t, y_n) - \partial_y f(t, \bar{y})\| \cdot 1 d\mu(t) \end{aligned}$$

Per ipotesi la funzione $y \mapsto \partial f(t, y)$ è continua, per cui

$$\|\partial_y f(t, y_n) - \partial_y f(t, \bar{y})\| \longrightarrow 0 \quad \text{per } n \rightarrow +\infty \text{ per ogni } t \in X.$$

D'altra parte

$$\|\partial_y f(t, y_n) - \partial_y f(t, \bar{y})\| \leq 2 \sup_{y \in U} \|\partial_y f(t, y)\|,$$

e quest'ultima è una funzione di t indipendente da n e in $L^1(\mu)$ per ipotesi. Pertanto

$$\begin{aligned} \|\partial_y F(y_n) - \partial_y F(\bar{y})\| &= \sup_{\substack{h \in Y \\ \|h\| \leq 1}} \left| \partial_y F(y_n)[h] - \partial_y F(\bar{y})[h] \right| \leq \\ &\leq \int_X \|\partial_y f(t, y_n) - \partial_y f(t, \bar{y})\| d\mu(t) \longrightarrow 0 \quad \text{per } n \rightarrow +\infty. \end{aligned}$$

2. Se a_n è una successione reale nulla per $n \geq N$ e b_n è una successione reale qualsiasi, allora

$$\Lambda_b(a) = \sum_{n \in \mathbb{N}} a_n b_n = \sum_{n=0}^N a_n b_n$$

è un numero reale ben definito perché solo un numero finito di addendi è non nullo. Se $a', a'' \in X$ e $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$ allora esistono $N', N'' \in \mathbb{N}$ tali che $a'_n = 0$ per $n > N'$, $a''_n = 0$ per $n > N''$. Quindi $(\alpha a' + \beta a'')_n = \alpha a'_n + \beta a''_n = 0$ se $n > \max\{N', N''\}$, e allora

$$\begin{aligned} \Lambda_b(\alpha a' + \beta a'') &= \sum_{n \in \mathbb{N}} (\alpha a' + \beta a'')_n b_n = \sum_{n=0}^{\max\{N', N''\}} (\alpha a'_n b_n + \beta a''_n b_n) = \\ &= \sum_{n=0}^{\max\{N', N''\}} \alpha a'_n b_n + \sum_{n=0}^{\max\{N', N''\}} \beta a''_n b_n = \\ &= \sum_{n \in \mathbb{N}} \alpha a'_n b_n + \sum_{n \in \mathbb{N}} \beta a''_n b_n = \alpha \Lambda_b(a') + \beta \Lambda_b(a''). \end{aligned}$$

Dunque $\Lambda_b: X \rightarrow \mathbb{R}$ è lineare.

a implica b. Supponiamo che la successione b sia in $\ell^2(\mathbb{N})$ e sia $a \in X \subset \ell^2(\mathbb{N})$. Allora per la disuguaglianza di Hölder (o di Schwarz) applicata alla serie (integrale rispetto alla misura del conteggio):

$$|\Lambda_b(a)| = \left| \sum_{n \in \mathbb{N}} a_n b_n \right| \leq \sum_{n \in \mathbb{N}} |a_n b_n| \leq \sqrt{\sum_{n \in \mathbb{N}} a_n^2} \sqrt{\sum_{n \in \mathbb{N}} b_n^2} = \|a\|_X \cdot \|b\|_{\ell^2},$$

per cui Λ_b risulta continua.

b implica c. Se $\Lambda_b: X \rightarrow \mathbb{R}$ è continua, allora il suo nucleo $\Lambda_b^{-1}(\{0\})$ è chiuso perché controimmagine del chiuso $\{0\} \subset \mathbb{R}$ tramite la funzione continua Λ_b .

c implica a. Dimostriamo che la negazione di **a** implica la negazione di **c**. Negare **a** significa affermare che

$$\sum_{n \in \mathbb{N}} |b_n|^2 = +\infty.$$

Bisogna dimostrare che il nucleo di Λ_b non è chiuso, cioè che esiste una successione $a^{(k)} \in X$ tale che $\Lambda_b(a^{(k)}) = 0$ per ogni k , mentre $a^{(k)}$ converge in X (cioè in $\ell^2(\mathbb{N})$) a un $\bar{a} \in X$ che non sta nel nucleo di Λ :

$$\forall k \in \mathbb{N} \quad a^{(k)} \in X \text{ e } \Lambda_b(a^{(k)}) = 0, \quad \bar{a} \in X, \quad \lim_{k \rightarrow +\infty} \|a^{(k)} - \bar{a}\|_{\ell^2} = 0, \quad \Lambda_b(\bar{a}) \neq 0.$$

Proviamo un caso speciale semplice: prendiamo b_n identicamente uguale a 1. Poniamo, se $k \geq 1$,

$$a_n^{(k)} := \begin{cases} -1 & \text{se } n = 0, \\ 1/k & \text{se } 1 \leq n \leq k, \\ 0 & \text{se } n > k. \end{cases}$$

Allora $a^{(k)}$ è in X perché $a_n^{(k)} \neq 0$ solo per un numero finito di n . Inoltre $a^{(k)}$ è nel nucleo di Λ_b per ogni $k \geq 1$:

$$\begin{aligned} \Lambda_b(a^{(k)}) &= \sum_{n \in \mathbb{N}} a_n^{(k)} b_n = \sum_{n=0}^k a_n^{(k)} b_n = a_0^{(k)} b_0 + \sum_{n=1}^k a_n^{(k)} b_n = -1 \cdot 1 + \sum_{n=1}^k \frac{1}{k} \cdot 1 = \\ &= -1 + \frac{1}{k} \sum_{n=1}^k 1 = -1 + \frac{1}{k} \cdot k = -1 + 1 = 0 \quad \forall k \geq 1. \end{aligned}$$

Se definiamo \bar{a} come

$$\bar{a}_n := \begin{cases} -1 & \text{se } n = 0, \\ 0 & \text{se } n \geq 1, \end{cases}$$

allora $\bar{a} \in X$ perché \bar{a}_n è nullo eccetto che per un numero finito di n , e

$$\begin{aligned} \|a^{(k)} - \bar{a}\|_{\ell^2}^2 &= \sum_{n \in \mathbb{N}} |a_n^{(k)} - \bar{a}_n|^2 = |a_0^{(k)} - \bar{a}_0|^2 + \sum_{n=1}^k |a_n^{(k)} - \bar{a}_n|^2 = \\ &= |(-1) - (-1)|^2 + \sum_{n=1}^k \left| \frac{1}{k} - 0 \right|^2 = 0 + \frac{1}{k^2} \sum_{n=1}^k 1 = \frac{1}{k^2} \cdot k = \frac{1}{k}, \end{aligned}$$

per cui $a^{(k)} \rightarrow \bar{a}$ in $\ell^2(\mathbb{N})$ per $k \rightarrow +\infty$. Infine \bar{a} non è nel nucleo di Λ_b :

$$\Lambda_b(\bar{a}) = \sum_{n \in \mathbb{N}} \bar{a}_n b_n = \bar{a}_0 b_0 = (-1) \cdot 1 = -1 \neq 0.$$

Veniamo al caso generale in cui l'unica ipotesi è $\sum b_n^2 = +\infty$. Siano n_1, n_2 rispettivamente il primo e il secondo indice per i quali $b_n \neq 0$. Poniamo

$$s_n := \sum_{k=n_2}^n b_k^2 \quad \text{per } n \geq n_2.$$

È chiaro che $s_n > 0$ per $n \geq n_2$ e che $n \mapsto s_n$ tende a $+\infty$ per $n \rightarrow +\infty$. Poniamo anche

$$a_n^{(k)} := \begin{cases} -1/b_{n_1} & \text{per } n = n_1, \\ b_n/s_k & \text{per } n_2 \leq n \leq k, \\ 0 & \text{altrimenti,} \end{cases} \quad \bar{a}_n := \begin{cases} -1/b_{n_1} & \text{per } n = n_1, \\ 0 & \text{altrimenti.} \end{cases}$$

Risulta che $a^{(k)} \in X$ perché $a_n^{(k)} \neq 0$ solo per un numero finito di $n \in \mathbb{N}$. Lo stesso per \bar{a} . Inoltre gli $a^{(k)}$ sono nel nucleo di Λ_b :

$$\Lambda_b(a^{(k)}) = \sum_{n \in \mathbb{N}} a_n^{(k)} b_n = \left(-\frac{1}{b_{n_1}}\right) b_{n_1} + \sum_{n=n_2}^k \frac{b_n}{s_k} \cdot b_n = -1 + \frac{1}{s_k} \sum_{n=n_2}^k b_n^2 = -1 + \frac{1}{s_k} \cdot s_k = -1 + 1 = 0,$$

e convergono ad \bar{a} nella norma di $\ell^2(\mathbb{N})$ per $k \rightarrow +\infty$:

$$\begin{aligned} \|a^{(k)} - \bar{a}\|_{\ell^2}^2 &= \sum_{n \in \mathbb{N}} |a_n^{(k)} - \bar{a}_n|^2 = |a_{n_1}^{(k)} - \bar{a}_{n_1}|^2 + \sum_{n=n_2}^k |a_n^{(k)} - \bar{a}_n|^2 = \\ &= \left| \left(-\frac{1}{b_{n_1}}\right) - \left(-\frac{1}{b_{n_1}}\right) \right|^2 + \sum_{n=n_2}^k \left| \frac{b_n}{s_k} - 0 \right|^2 = 0 + \sum_{n=n_2}^k \frac{b_n^2}{s_k^2} = \frac{1}{s_k^2} \sum_{n=n_2}^k b_n^2 = \\ &= \frac{1}{s_k^2} \cdot s_k = \frac{1}{s_k} \longrightarrow 0 \quad \text{per } k \rightarrow +\infty. \end{aligned}$$

Infine \bar{a} non è nel nucleo di Λ_b :

$$\Lambda_b(\bar{a}) = \sum_{n \in \mathbb{N}} \bar{a}_n b_n = \bar{a}_{n_1} b_{n_1} = \left(-\frac{1}{b_{n_1}}\right) b_{n_1} = -1 \neq 0.$$