

# Wirtschaftsmathematik

für International Management (BA) und Betriebswirtschaft (BA)

Wintersemester 2014/15

Stefan Etschberger  
Hochschule Augsburg

1 Grundlegende Bausteine

2 Grundlegende Werkzeuge

3 Aussagenlogik

4 Lineare Algebra

5 Lineare Programme

6 Folgen und Reihen

7 Finanzmathematik

8 Reelle Funktionen

9 Differenzieren 1

10 Differenzieren 2

11 Integration

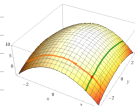
12 Differentialgleichungen



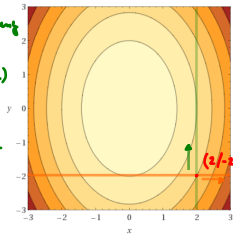
10 Differenzieren 2  
Partielle Ableitung  
Kurvendiskussion  
Optimierung mit Nebenbedingungen

Differentialrechnung von  $f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$

Beispiel:  $f(x,y) = 10 - x^2 - \frac{1}{2}y^2$



ges.: Steigung von  $f$  in Richtung des positiven  $y$ -Achse im Punkt  $(2/-2)$   
 dazu: neue Funktion  
 $h(y) = f(2, y)$   
 $= 10 - 2^2 - \frac{1}{2}y^2$   
 $= 6 - \frac{1}{2}y^2$   
 $h'(y) = -y$   
 $h'(-2) = 2$



ges.: Steigung von  $f$  in Richtung des positiven  $x$ -Achse im Punkt  $(2/-2)$   
 dazu: neue Funktion  
 $g(x) = f(x, -2)$   
 $= 10 - x^2 - \frac{1}{2}(-2)^2$   
 $= 8 - x^2$   
 Abl. von  $g(x)$   
 $g'(x) = -2x$   
 $g'(2) = -2 \cdot 2 = -4$

Partielle Ableitung

Partielle Ableitung nach  $x$ : Setze  $y$  konstant und leite nach  $x$  ab

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x,y) = f_x(x,y)$$

Beispiel:  $f(x,y) = 10 - x^2 - \frac{1}{2}y^2$

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x,y) = 0 - 2x - 0 = -2x$$

Abl. von  $y^2$  nach  $x$  ist 0 ( $y$  ist konstant)

Analog: Part. Abl. nach  $y$  (hier  $x$  konstant)

$$\frac{\partial f}{\partial y}(x,y) = 0 - 0 - y = -y$$

Abl. von  $-x^2$  nach  $y$  ist 0 ( $x$  ist konstant)

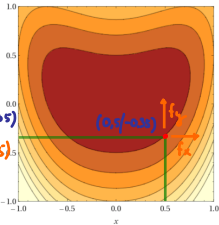
Beispiel:  $f(x,y) = x^4 + y^2 - x^2y$

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x,y) = 4x^3 + 0 - 2xy$$

$$\frac{\partial f}{\partial y}(x,y) = 0 + 2y - x^2$$

$$f_x(0,5/-0,35) = 4 \cdot 0,5^3 - 2 \cdot 0,5 \cdot (-0,35) = \frac{1}{2} + 0,35 = 0,85$$

$$f_y(0,5/-0,35) = 2 \cdot (-0,35) - 0,5^2 = -0,7 - 0,25 = -0,95$$



Gradient: Vektor der partiellen Ableitungen

$$\text{grad}(f(x,y)) = \nabla f(x,y) = \begin{pmatrix} f_x \\ f_y \end{pmatrix}$$

↳ Nabla-Operator

Beispiel:  $f(x,y) = x^4 + y^2 - x^2y$

$$\Rightarrow \nabla f(x,y) = \begin{pmatrix} 4x^3 - 2xy \\ 2y - x^2 \end{pmatrix}$$

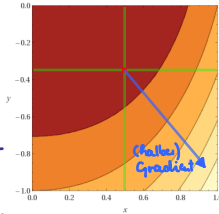
$$\nabla f(0,5/-0,35) = \begin{pmatrix} 0,85 \\ -0,95 \end{pmatrix}$$

Beobachtungen:

▷  $\nabla f$  zeigt immer in Richtung des stärksten Anstiegs von  $f$

▷  $-\nabla f$  zeigt in Rg. des stärksten Abfalls von  $f$

▷  $90^\circ$  von  $\nabla f$  gedreht: Richtung der Höhenlinie



Richtungsableitung von  $f(x,y)$  in Richtung des Vektors  $r$  (Länge von  $r$  gleich 1)

$$[\nabla f(x,y)]^T \cdot r$$

Beispiel:  
 $f(x,y) = x^4 + y^2 - x^2y$

ges: Richtungsableitung  
 in Richtung  $(2/1)$   
 im Punkt  $(-1/-2)$

Normiere Richtung auf  
 Länge 1:

$$\| \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} \| = \sqrt{2^2 + 1^2} = \sqrt{5}$$

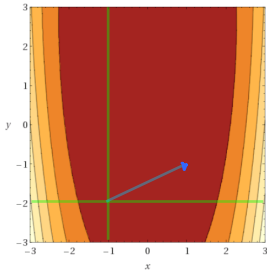
$$\Rightarrow r = \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} \Rightarrow \text{Richtungsableitung:}$$

$$\begin{aligned} [\nabla f(x,y)]^T \cdot r &= (4 \cdot (-1)^3 - 2 \cdot (-1) \cdot (-2) \quad 2 \cdot (-2) - (-1)^2) \cdot \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} \\ &= (-8 \quad -5) \cdot \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} = \frac{1}{\sqrt{5}} \cdot (-16 - 5) \\ &= \frac{-21}{\sqrt{5}} \approx -9,39 \end{aligned}$$

Extremwertbestimmung von  $f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$

Notwendiges Kriterium für Extremwert

$$\nabla f(x_1, \dots, x_n) = 0$$



## 2. Ableitungen und Hessematrix

$$f(x,y) \begin{cases} f_x & \begin{cases} f_{xx} = \frac{\partial^2 f}{\partial x^2}(x,y) \\ f_{xy} = \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}(x,y) \end{cases} \\ f_y & \begin{cases} f_{yx} = \frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}(x,y) \\ f_{yy} = \frac{\partial^2 f}{\partial y^2}(x,y) \end{cases} \end{cases}$$

Satz von Schwarz: Bei den „meisten“ Funktionen gilt  $f_{xy} = f_{yx}$

Beispiel:  $f(x,y) = x^4 + y^2 - x^2y$

$$f \begin{cases} f_x = 4x^3 - 2xy & \begin{cases} f_{xx} = 12x^2 - 2y \\ f_{xy} = -2x \end{cases} \\ f_y = 2y - x^2 & \begin{cases} f_{yx} = -2x \\ f_{yy} = 2 \end{cases} \end{cases}$$

Hessematrix  $H_f(x,y) = \begin{pmatrix} f_{xx} & f_{xy} \\ f_{yx} & f_{yy} \end{pmatrix}$

Kriterien für Extremwerte ( $\nabla f = 0$ )

$$\det H_f(x,y) > 0 \begin{cases} \rightarrow f_{xx} > 0 \Rightarrow \text{Minimum} \\ \rightarrow f_{xx} < 0 \Rightarrow \text{Maximum} \end{cases}$$

$$\det H_f(x,y) < 0 \longrightarrow \Rightarrow \text{Sattel}$$

$$(\det H_f = 0 \Rightarrow \text{keine Aussage möglich})$$

Beispiel:  $f(x,y) = x^2 + y^4 - 2xy$

gesucht: Extremwerte

①  $\nabla f = 0$

$$\nabla f = \begin{pmatrix} 2x - 2y \\ 4y^3 - 2x \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

$$\Leftrightarrow \begin{cases} x=y \\ 2y^3=y \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} 2y^2-y=0 \\ 2y(y-\frac{1}{2})=0 \end{cases} \Rightarrow (x,y) = \begin{pmatrix} 0/0 \\ (\sqrt{\frac{1}{2}}/\sqrt{\frac{1}{2}}) \\ (-\sqrt{\frac{1}{2}}/-\sqrt{\frac{1}{2}}) \end{pmatrix}$$

② Einsetzen des Kandidaten in Hessematrix

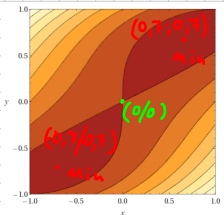
$$H_f(x,y) = \begin{pmatrix} f_{xx} & f_{xy} \\ f_{yx} & f_{yy} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 2 & -2 \\ -2 & 12y^2 \end{pmatrix}$$

$$H_f(0,0) = \begin{pmatrix} 2 & -2 \\ -2 & 0 \end{pmatrix} \Rightarrow \det H_f(0,0) = 2 \cdot 0 - (-2) \cdot (-2) = -4 < 0$$

$\Rightarrow$  Sattelpunkt bei (0/0)

$$H_f(\pm\sqrt{\frac{1}{2}}, \pm\sqrt{\frac{1}{2}}) = \begin{pmatrix} 2 & -2 \\ -2 & 6 \end{pmatrix} \Rightarrow \det H_f = 2 \cdot 6 - (-2) \cdot (-2) = 8 > 0$$

da  $f_{xx} = 2$  ist  $(\pm\sqrt{\frac{1}{2}}, \pm\sqrt{\frac{1}{2}})$  ein Minimum



Optimierung mit Nebenbedingungen

Beispiel:  $f(x,y) = x^2 + 2y^2 \rightarrow \min.$

unter Restriktion:  $g = 2y + x - 3 = 0$

allg. gilt im Optimum:  $\lambda \nabla g + \nabla f = 0$

① Aufstellen der sog. Lagrangefunktion

$$L(x,y,\lambda) = f(x,y) + \lambda g(x,y)$$

② Notwendigen Kriterium für Optimum

$$\nabla L = \begin{pmatrix} L_x \\ L_y \\ L_\lambda \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

③ Hinreichend für Optimum

$$\det \hat{H}_L(x,y,\lambda) = \det \begin{pmatrix} L_{xx} & L_{xy} \\ L_{yx} & L_{yy} \end{pmatrix} > 0$$

und  $L_{xx}$  muss entspr. Vorzeichen haben

zurück zum Beispiel:

①  $L(x,y,\lambda) = x^2 + 2y^2 + \lambda(2y + x - 3)$

②  $\nabla L = \begin{pmatrix} 2x + \lambda \\ 4y + 2\lambda \\ 2y + x - 3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} \Rightarrow \begin{cases} 2x - 2\lambda = 0 \Rightarrow x=y \\ 2y + x - 3 = 0 \Rightarrow x=y=1 \end{cases}$

③  $\hat{H}_L = \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 0 & 4 \end{pmatrix} \Rightarrow \det \hat{H}_L = 2 \cdot 4 - 0 \cdot 0 = 8 > 0$

und  $L_{xx} = 2 > 0 \Rightarrow \text{Min.}$

Optimal unter Restr.:  $(x,y) = (1,1)$



## Betrachtet werden

- ▶ Funktionen  $f : D \rightarrow \mathbb{R}$ ,  $D \in \mathbb{R}^n$
- ▶ mit  $x = (x_1, \dots, x_n) \mapsto f(x) = f(x_1, \dots, x_n) = z$
- ▶ außerdem:  $i$ -ter Einheitsvektor  $e_i = (0, \dots, 0, 1, 0, \dots, 0)$
- ▶ und:  $x + h \cdot e_i \in D$  mit  $h > 0$

## Definition

- ▶  $f$  heißt im Punkt  $x$  **partiell differenzierbar** bei Existenz des Grenzwerts:

$$\lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(x + h \cdot e_i) - f(x)}{h}$$

- ▶ In diesem Fall heißt dieser Grenzwert  $f_{x_i}(x)$  die **erste partielle Ableitung** von  $f$  nach  $x_i$  im Punkt  $x$ . Schreibweisen:

$$f^i(x) = f_{x_i}(x) = \frac{\partial f(x)}{\partial x_i}$$

1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs



## Differenzierbarkeit auf $D_1 \subset D$

- ▶ Die Funktion  $f : D \supset \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$
- ▶ heißt in  $D_1 \subset D$  **partiell differenzierbar**
- ▶ wenn  $f$  für alle  $x \in D_1$  partiell differenzierbar ist

## Gradient

- ▶ Ist die Funktion  $f : D \supset \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$  im Punkt  $x$
- ▶ nach allen Variablen  $x_1, \dots, x_n$  differenzierbar, dann heißt

$$\text{grad } f(x) = \nabla f(x) = \begin{pmatrix} \frac{\partial f(x)}{\partial x_1} \\ \vdots \\ \frac{\partial f(x)}{\partial x_n} \end{pmatrix}$$

- ▶ **Gradient** von  $f$  im Punkt  $x \in D$

1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs



## Tangentialebene

- ▶ Gegeben:  $f : D \subset \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$  und ein Punkt  $\tilde{x} = (\tilde{x}_1, \tilde{x}_2)$
- ▶ Gesucht: Ebene, die  $f$  in  $\tilde{x}$  berührt
- ▶ **Tangentialebene:**  
$$T(x_1, x_2) = f(\tilde{x}) + \frac{\partial f}{\partial x_1}(\tilde{x}) \cdot (x_1 - \tilde{x}_1) + \frac{\partial f}{\partial x_2}(\tilde{x}) \cdot (x_2 - \tilde{x}_2)$$

## Tangentialhyperebene

- ▶ Gegeben:  $f : D \subset \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$  und ein Punkt  $\tilde{x}$
- ▶ Gesucht: Ebene, die  $f$  in  $\tilde{x}$  berührt
- ▶ **Tangentialhyperebene:**

$$H(x) = f(\tilde{x}) + (\nabla f(\tilde{x}))^T \cdot (x - \tilde{x})$$

1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

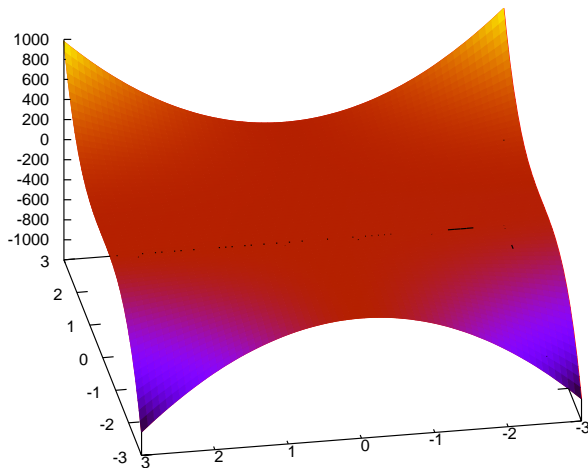
11. Integration

12. DGLs





- ▶ Gegeben:  $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$  mit  $f(x, y) = 4x^3y^2 + 2y$
- ▶ Gesucht: Tangentialebene im Punkt  $(1, -2, f(1, -2))$



1. Grundlegende Bausteine
2. Grundlegende Werkzeuge
3. Aussagenlogik
4. Lineare Algebra
5. Lineare Programme
6. Folgen und Reihen
7. Finanzmathematik
8. Reelle Funktionen
9. Differenzieren 1
10. Differenzieren 2
- 10.1. Partielle Ableitung
- 10.2. Kurvendiskussion
- 10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen
11. Integration
12. DGLs



## Voraussetzungen

- ▶  $f : \mathbb{R}^n \supset D \rightarrow \mathbb{R}$  und ein Punkt  $x \in D$
- ▶ mit stetig partiellen Ableitungen in  $D$  und
- ▶ ein Punkt  $x \in D$
- ▶ und ein Richtungsvektor  $r \in D$  mit  $\|r\| = 1$ .
- ▶ Außerdem: Es existiert sowohl ein  $\epsilon > 0$  mit  $[x - \epsilon r; x + \epsilon r] \in D$
- ▶ als auch der Grenzwert

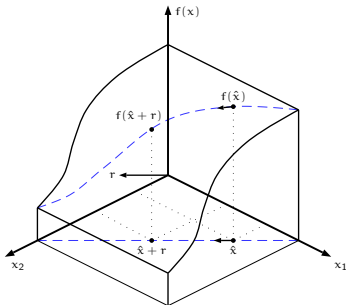
$$\lim_{t \rightarrow 0} \frac{f(x + t \cdot r) - f(x)}{t}$$

## Richtungsableitung

- ▶ Dann heißt

$$(\nabla f(x))^T \cdot r$$

**Richtungsableitung** von  $f$  an der Stelle  $x$  in Richtung  $r$



1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

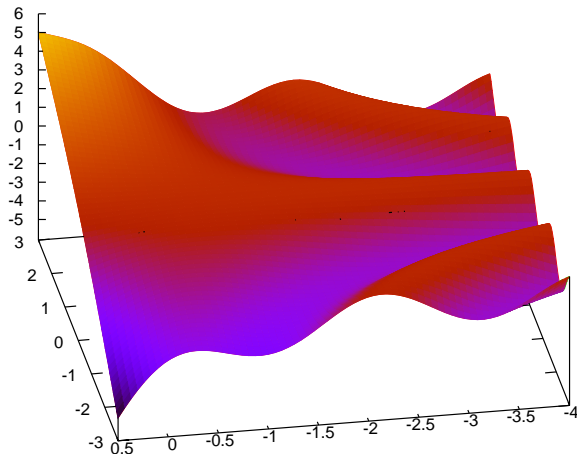
10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs



- ▶ Gegeben:  $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$  mit  $f(x, y) = x e^y + \cos(xy)$
- ▶ Gesucht: Ableitung im Punkt  $(2,0)$  in Richtung des Vektors  $\begin{pmatrix} 3 \\ -4 \end{pmatrix}$



1. Grundlegende Bausteine
2. Grundlegende Werkzeuge
3. Aussagenlogik
4. Lineare Algebra
5. Lineare Programme
6. Folgen und Reihen
7. Finanzmathematik
8. Reelle Funktionen
9. Differenzieren 1
10. Differenzieren 2
- 10.1. Partielle Ableitung
- 10.2. Kurvendiskussion
- 10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen
11. Integration
12. DGLs



## Voraussetzungen

- ▶ Funktion  $f : D \rightarrow \mathbb{R}$ ,  $D \subset \mathbb{R}^n$
- ▶ in  $D$  nach allen Variablen  $x_1, \dots, x_n$  partiell differenzierbar,
- ▶ auch partiell differenzierbar: alle partiellen Ableitungen  $f_{x_1}, \dots, f_{x_n}$ .

## Dann heißt

- ▶  $f$  **zweimal partiell** nach allen Variablen **differenzierbar**.
- ▶ **Partielle Ableitungen zweiter Ordnung** für  $i, j = 1, \dots, n$ :

$$f^{ij}(x) = f_{x_i x_j}(x) = \frac{\partial}{\partial x_j} \left( \frac{\partial}{\partial x_i} f(x) \right) = \frac{\partial^2 f(x)}{\partial x_j \partial x_i}$$

- ▶ Achtung: Zuerst nach  $x_i$ , dann nach  $x_j$  differenzieren

1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs



## Voraussetzungen

- ▶  $f : \mathbb{R}^n \supset D \rightarrow \mathbb{R}$  ist zweimal stetig partiell differenzierbar in  $D$
- ▶ 2. partielle Ableitungen:

$$\frac{\partial^2 f(x)}{\partial x_i \partial x_j}$$

- ▶ mit  $i, j \in \{1, \dots, n\}$

Dann gilt für alle  $x \in D$

$$\frac{\partial^2 f(x)}{\partial x_i \partial x_j} = \frac{\partial^2 f(x)}{\partial x_j \partial x_i}$$



Hermann Schwarz (1843-1921)

1. Grundlegende Bausteine
2. Grundlegende Werkzeuge
3. Aussagenlogik
4. Lineare Algebra
5. Lineare Programme
6. Folgen und Reihen
7. Finanzmathematik
8. Reelle Funktionen
9. Differenzieren 1
10. Differenzieren 2
- 10.1. Partielle Ableitung
- 10.2. Kurvendiskussion
- 10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen
11. Integration
12. DGLs

## Gegeben

- ▶ Zweimal stetig partiell differenzierbare Funktion  $f : \mathbb{R}^n \supset D \rightarrow \mathbb{R}$

## Definition

- ▶ Die symmetrische Matrix



$$H_f(\mathbf{x}) = \left( \frac{\partial^2 f}{\partial x_i \partial x_j} \right) = \begin{pmatrix} \frac{\partial^2 f}{\partial x_1 \partial x_1} & \frac{\partial^2 f}{\partial x_1 \partial x_2} & \cdots & \frac{\partial^2 f}{\partial x_1 \partial x_n} \\ \frac{\partial^2 f}{\partial x_2 \partial x_1} & \frac{\partial^2 f}{\partial x_2 \partial x_2} & \cdots & \frac{\partial^2 f}{\partial x_2 \partial x_n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \frac{\partial^2 f}{\partial x_n \partial x_1} & \frac{\partial^2 f}{\partial x_n \partial x_2} & \cdots & \frac{\partial^2 f}{\partial x_n \partial x_n} \end{pmatrix}$$

heißt **Hessematrix**



1. Grundlegende Bausteine
2. Grundlegende Werkzeuge
3. Aussagenlogik
4. Lineare Algebra
5. Lineare Programme
6. Folgen und Reihen
7. Finanzmathematik
8. Reelle Funktionen
9. Differenzieren 1
10. Differenzieren 2
  - 10.1. Partielle Ableitung
  - 10.2. Kurvendiskussion
  - 10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen
11. Integration
12. DGLs

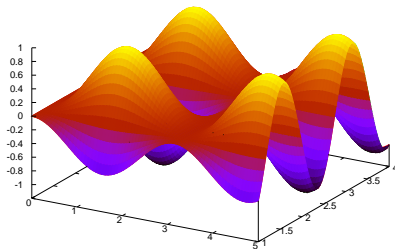


## Notwendige Bedingung für lokale Extrema

- ▶ Gegeben: Funktion  $f : \mathbb{R}^n \supset D \rightarrow \mathbb{R}$  stetig partiell nach allen Variablen differenzierbar
- ▶  $f$  hat im Punkt  $\tilde{x}$  ein lokales Minimum oder Maximum
- ▶ Dann gilt:  $\nabla f(\tilde{x}) = 0$

## Beispiel

- ▶  $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$
- ▶  $f(x, y) = \sin^2(x) \cdot \cos(4y)$



1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs



## Am Punkt $\tilde{x}$ heißt die Hessematrix $H_f(\tilde{x})$

- ▶ **positiv definit**, wenn  $x^T H_f(\tilde{x}) x > 0$ ,
- ▶ **positiv semidefinit**, wenn  $x^T H_f(\tilde{x}) x \geq 0$ ,
- ▶ **negativ definit**, wenn  $x^T H_f(\tilde{x}) x < 0$ ,
- ▶ **negativ semidefinit**, wenn  $x^T H_f(\tilde{x}) x \leq 0$
- ▶ jeweils für alle  $x$  gilt.
- ▶ Andernfalls heißt  $H_f(\tilde{x})$  **indefinit**.

1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs





1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs

## Hauptunterdeterminanten

- ▶ Gegeben: Symmetrische  $n \times n$ -Matrix  $A$
- ▶ Dann heißt

$$\det H_i = \det \begin{pmatrix} a_{11} & \cdots & a_{1i} \\ \vdots & & \vdots \\ a_{i1} & \cdots & a_{ii} \end{pmatrix}$$

die  $i$ -te **Hauptunterdeterminante** ( $i = 1, \dots, n$ ) von  $A$ .

## Satz

- ▶ Matrix  $A$  positiv definit  $\Leftrightarrow \det H_i > 0$   
 $\Leftrightarrow$  alle Eigenwerte von  $A$  sind positiv
- ▶ Matrix  $A$  negativ definit  $\Leftrightarrow (-1)^i \det H_i > 0$   
 $\Leftrightarrow$  alle Eigenwerte von  $A$  sind negativ



## Voraussetzungen

- ▶  $D \subset \mathbb{R}^n$  konvex und offen
- ▶ Funktion  $f : D \rightarrow \mathbb{R}$  zweimal stetig partiell differenzierbar
- ▶ Es gibt ein  $\tilde{x}$ , für das  $\nabla f(\tilde{x}) = 0$

## Satz

- ▶  $H_f(\tilde{x})$  ist negativ definit  $\Rightarrow \tilde{x}$  ist lokale Maximalstelle von  $f$
- ▶  $H_f(\tilde{x})$  ist positiv definit  $\Rightarrow \tilde{x}$  ist lokale Minimalstelle von  $f$
- ▶  $H_f(\tilde{x})$  ist indefinit  $\Rightarrow \tilde{x}$  ist keine lokale Extremalstelle von  $f$
  
- ▶  $H_f(x)$  ist positiv definit für alle  $x \in D$   
 $\Rightarrow \tilde{x}$  ist einziges globales Minimum von  $f$
- ▶  $H_f(x)$  ist negativ definit für alle  $x \in D$   
 $\Rightarrow \tilde{x}$  ist globales Maximum von  $f$

1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs



## Voraussetzungen

- ▶  $D \subset \mathbb{R}^n$  konvex und offen
- ▶ Funktion  $f : D \rightarrow \mathbb{R}$  zweimal stetig partiell differenzierbar

## Satz

- ▶  $H_f(x)$  ist positiv definit für alle  $x \in D$   
 $\Rightarrow f$  ist streng konvex in  $D$
- ▶  $H_f(x)$  ist negativ definit für alle  $x \in D$   
 $\Rightarrow f$  ist streng konkav in  $D$
- ▶  $H_f(x)$  ist positiv semidefinit für alle  $x \in D$   
 $\Rightarrow f$  ist konvex in  $D$
- ▶  $H_f(x)$  ist negativ semidefinit für alle  $x \in D$   
 $\Rightarrow f$  ist konkav in  $D$

1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

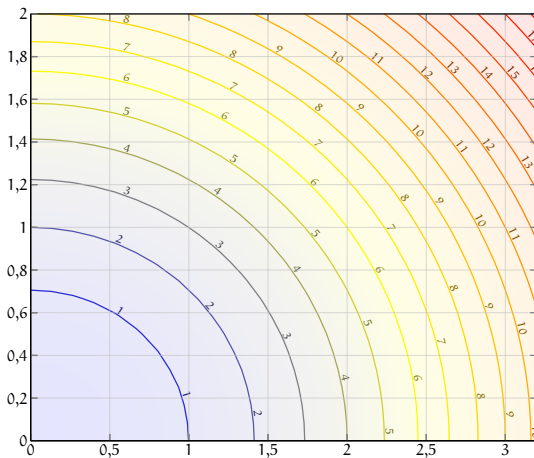
10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs

## Problem

- ▶ Betrachte  $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$  mit  $f(x, y) = x^2 + 2y^2$
- ▶ Gesucht: Punkt in  $\mathbb{R}^2$  mit kleinstem Wert von  $f$
- ▶ auf der Geraden  $2y + x - 3 = 0$



1. Grundlegende Bausteine
2. Grundlegende Werkzeuge
3. Aussagenlogik
4. Lineare Algebra
5. Lineare Programme
6. Folgen und Reihen
7. Finanzmathematik
8. Reelle Funktionen
9. Differenzieren 1
10. Differenzieren 2
  - 10.1. Partielle Ableitung
  - 10.2. Kurvendiskussion
  - 10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen
11. Integration
12. DGLs



## Aufgabe

- ▶ Maximiere (oder minimiere) Funktion  $f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$
- ▶ in Abhängigkeit von  $x = (x_1, \dots, x_n)$ ,
- ▶ so dass die Nebenbedingungen  $g^i(x) = 0$  mit  $g^i: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$  und  $i = 1, \dots, m$  erfüllt sind
- ▶ Kurz:

$$f(x) \rightarrow \max \quad (\min)$$

$$\text{NB: } g^1(x) = 0$$

$$\vdots$$

$$g^m(x) = 0$$

1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

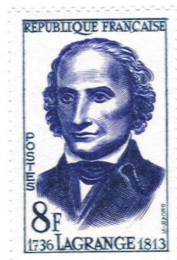
10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs

## Idee von Lagrange

- ▶ Gut wäre: Transformation des Optimierungsproblems mit Nebenbedingungen in eines ohne NB.
- ▶ Im Optimum: Gradient der zu optimierenden Funktion und Gradient der NB sind parallel



## Lagrangefunktion

- ▶ Gegeben: Optimierungsproblem (O) mit  $f(x) \rightarrow \max(\min)$  unter den Nebenbedingungen  $g^j(x) = 0$  für  $j = 1, \dots, m$
- ▶ Dazu wird definiert: **Lagrangefunktion**  $L : \mathbb{R}^{n+m} \rightarrow \mathbb{R}$

$$L(x_1, \dots, x_n, \lambda_1, \dots, \lambda_m) = L(x, \lambda) = f(x) + \sum_{j=1}^m \lambda_j g^j(x)$$



1. Grundlegende Bausteine
2. Grundlegende Werkzeuge
3. Aussagenlogik
4. Lineare Algebra
5. Lineare Programme
6. Folgen und Reihen
7. Finanzmathematik
8. Reelle Funktionen
9. Differenzieren 1
10. Differenzieren 2
  - 10.1. Partielle Ableitung
  - 10.2. Kurvendiskussion
  - 10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen
11. Integration
12. DGLs



## Voraussetzungen

- ▶  $f : \mathbb{R}^n \supset D \rightarrow \mathbb{R}$ , zweimal stetig partiell differenzierbar
- ▶ Optimierungsproblem (O) mit  $f(x) \rightarrow \max$  (min) unter den Nebenbedingungen  $g^j(x) = 0$  für  $j = 1, \dots, m$
- ▶ Hessematrix der Lagrangefunktion:

$$\hat{H}_L(x, \lambda) = \begin{pmatrix} \frac{\partial^2 L(x, \lambda)}{\partial x_1 \partial x_1} & \cdots & \frac{\partial^2 L(x, \lambda)}{\partial x_1 \partial x_n} \\ \vdots & & \vdots \\ \frac{\partial^2 L(x, \lambda)}{\partial x_n \partial x_1} & \cdots & \frac{\partial^2 L(x, \lambda)}{\partial x_n \partial x_n} \end{pmatrix}$$

- ▶ Eine Lösung  $(\tilde{x}, \tilde{\lambda})$  des Systems  $\nabla L(x, \lambda) = 0$

## Dann gilt:

- ▶  $\hat{H}_L(\tilde{x}, \tilde{\lambda})$  negativ definit  $\Rightarrow \tilde{x}$  ist lokales Maximum von (O)
- ▶  $\hat{H}_L(\tilde{x}, \tilde{\lambda})$  positiv definit  $\Rightarrow \tilde{x}$  ist lokales Minimum von (O)
- ▶  $\hat{H}_L(x, \tilde{\lambda})$  negativ definit für alle  $x \Rightarrow \tilde{x}$  ist globales Maximum von (O)
- ▶  $\hat{H}_L(x, \tilde{\lambda})$  positiv definit für alle  $x \Rightarrow \tilde{x}$  ist globales Minimum von (O)

1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs



## Voraussetzungen

- ▶  $f : \mathbb{R}^n \supset D \rightarrow \mathbb{R}$ , zweimal stetig partiell differenzierbar
- ▶ Optimierungsproblem (O) mit  $f(x) \rightarrow \max$  ( $\min$ ) unter den Nebenbedingungen  $g^j(x) = 0$  für  $j = 1, \dots, m$
- ▶ Lagrangefunktion

$$\hat{L}(x) = f(x) + \sum_{j=1}^m \lambda(x) g^j(x)$$

## Dann gilt:

- ▶ Ist  $\tilde{x}$  eine Maximalstelle bzw. Minimalstelle von  $\hat{L}$
- ▶ mit  $g^j(\tilde{x}) = 0$  für alle  $j = 1, \dots, m$
- ▶ dann ist  $\tilde{x}$  auch Maximalstelle bzw. Minimalstelle von (O)

1. Grundlegende Bausteine

2. Grundlegende Werkzeuge

3. Aussagenlogik

4. Lineare Algebra

5. Lineare Programme

6. Folgen und Reihen

7. Finanzmathematik

8. Reelle Funktionen

9. Differenzieren 1

10. Differenzieren 2

10.1. Partielle Ableitung

10.2. Kurvendiskussion

10.3. Optimierung mit Nebenbedingungen

11. Integration

12. DGLs