

Umkehrsatz und Satz über implizite Funktionen 4.7.2016

Wir betrachten die Gleichung für $a > 0$ und $x > 0$.

$$x^2 = a \stackrel{x > 0}{\Leftrightarrow} x = \frac{a}{x} \Leftrightarrow 2x = x + \frac{a}{x} \Leftrightarrow x = \frac{1}{2} \left(x + \frac{a}{x} \right) =: f(x)$$

Wir definieren die Folge:

$$x_0 = a, x_{n+1} := \frac{1}{2} \left(x_n + \frac{a}{x_n} \right) = f(x_n) \quad \forall n \in \mathbb{N}_0.$$

Konvergiert diese Folge gegen den Fixpunkt $x = f(x)$, d.h.

gegen $x = \sqrt{a}$? Bsp. $a = 2$

$$x_0 = 2; x_1 = \frac{1}{2} \left(2 + \frac{2}{2} \right) = \frac{3}{2} = 1,5; x_2 = 1,416; x_3 = 1,414 \dots$$

Unter bestimmten Annahmen stimmt das. Dazu die folgende Definition:

Def.: Sei (X, d) ein metrischer Raum. Eine Abbildung

$f: X \rightarrow X$ heißt Kontraktion, falls es ein $q \in [0, 1)$

gibt mit

$$d(f(x), f(y)) \leq q d(x, y) \quad \forall x, y \in X,$$

d.h. f ist Lipschitz-stetig mit Lipschitz-Konstante

$q \in [0, 1)$.

Satz (Banachscher Fixpunktsatz)

Ist (X, d) ein nichtleerer vollständiger metrischer Raum, und ist $f: X \rightarrow X$ eine Kontraktion, so hat

f genau einen Fixpunkt $\xi \in X$. Für jedes $x \in X$

konvergiert die Folge

$$x_0 := x, x_{n+1} := f(x_n) \quad \forall n \in \mathbb{N}_0$$

gegen ξ und es gilt die Abschätzung $d(x_n, \xi) \leq \frac{q^n}{1-q} d(x_1, x_0)$.

Beweis: Sei $x_0 \in X$ bel. Definiere $x_{n+1} = f(x_n) \quad \forall n \in \mathbb{N}_0$.

Dann folgt $d(x_{n+1}, x_n) \leq q d(x_n, x_{n-1}) \leq \dots \leq q^n d(x_1, x_0)$

$$\Rightarrow d(x_{n+p}, x_n) \leq d(x_{n+p}, x_{n+p-1}) + \dots + d(x_{n+1}, x_n)$$

$$\leq (q^{n+p-1} + \dots + q^n) d(x_1, x_0)$$

$$= \frac{q^n}{1-q} \underbrace{(1-q)(q^{p-1} + \dots + 1)}_{= 1-q^p} d(x_1, x_0)$$

$$= \frac{q^n (1-q^p)}{1-q} d(x_1, x_0) \leq \frac{q^n}{1-q} d(x_1, x_0) \quad \forall p \in \mathbb{N}$$

Also ist $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ eine Cauchyfolge in X .

Da X vollständig ist existiert ein Grenzwert $x = \lim_{n \rightarrow \infty} x_n$. Da eine Kontraktion stetig ist, folgt

$$f(x) = f\left(\lim_{n \rightarrow \infty} x_n\right) \stackrel{f \text{ stetig}}{=} \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} x_{n+1} = x.$$

Eindeutigkeit: Sei ξ ein weiterer Fixpunkt, dann folgt $d(\xi, x) = d(f(\xi), f(x)) \leq q d(\xi, x)$
 $\stackrel{q < 1}{\Leftrightarrow} d(\xi, x) = 0 \stackrel{(\mu 1)}{\Leftrightarrow} \xi = x. \quad \square$

Bemerkung: Sei $D \subset \mathbb{R}^n$ und $f \in C^1(D, D)$. Dann gilt nach dem Schrankensatz

$$\|f(y) - f(x)\| \leq \sup_{t \in [0, 1]} \|df((1-t)x + ty)\|_{op} \|y - x\|$$

$\Rightarrow f$ ist Kontraktion, falls $\sup_{x \in D} \|df(x)\|_{op} < 1$.

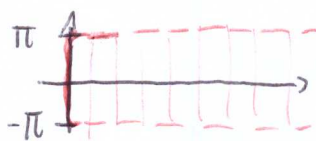
4.2. Def: Seien $D \subset \mathbb{R}^n, G \subset \mathbb{R}^m$ offen und sei $k \in \mathbb{N} \cup \{\infty\}$

- ▶ $f: D \rightarrow G$ heißt C^k -Diffeomorphismus, wenn $f \in C^k(D, G)$, f bijektiv und $f^{-1} \in C^k(G, D)$ ist
- ▶ f heißt lokaler C^k -Diffeomorphismus in $a \in D$, wenn offene Umgebungen U von a und V von $f(a)$ existieren, so dass $f: U \rightarrow V$ ein C^k -Diffeomorphismus ist.
- ▶ f heißt lokaler C^k -Diffeomorphismus, wenn f ein lokaler C^k -Diffeomorphismus in jedem $x \in D$ ist.



Beispiele: 1) $\exp: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}_+$ ist C^∞ -Diffeomorphismus mit $\exp^{-1} = \log: \mathbb{R}_+ \rightarrow \mathbb{R}$

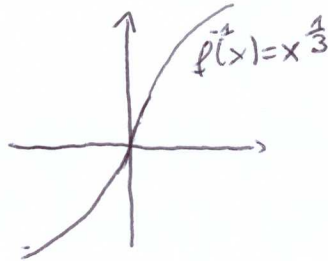
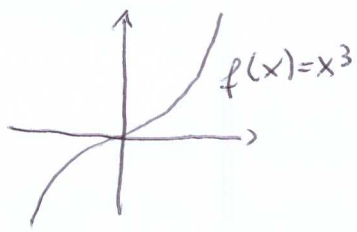
2) $P: (0, \infty) \times (-\pi, \pi) \rightarrow \mathbb{R}^2 \setminus (-\infty, 0] \times \{0\}$ ist C^∞ -Diffeo
 $(r, \varphi) \mapsto (r \cos \varphi, r \sin \varphi)$



$$P^{-1}(x, y) = \left(\sqrt{x^2 + y^2}, \begin{cases} \arccos \frac{x}{\sqrt{x^2 + y^2}}, & x \geq 0 \\ -\arccos \frac{x}{\sqrt{x^2 + y^2}}, & x < 0 \end{cases} \right)$$

P ist C^∞ -Diffeomorphismus

3) $f: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}, f(x) = x^3$ ist C^∞ , bijektiv aber kein Diffeomorphismus, weil $f^{-1}(y) = y^{1/3}$ nicht diffbar in $y=0$ ist



f ist lokaler C^∞ -Diffeomorphismus in allen $x \neq 0$.

4) $p: (0, \infty) \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^2 \setminus \{(0,0)\}$ kein Diffeomorphismus, da nicht injektiv $p(r, \varphi) = p(r, 2\pi k + \varphi) \forall k \in \mathbb{Z}$. Weitere Beispiele waren Kugelkoordinaten oder noch allgemeiner Polarkoordinaten im \mathbb{R}^n .

4.3 Satz Seien $D \subset \mathbb{R}^n, G \subset \mathbb{R}^n$ offen, $k \in \mathbb{N} \cup \{\infty\}$. Sei $f: D \rightarrow G$ ein C^k -Diffeomorphismus, $x \in D, y = f(x)$.

Dann gilt $df^{-1}(y) = [df(x)]^{-1}$ und $J_{f^{-1}}(y) = [J_f(x)]^{-1}$.

Insbesondere gilt $m = n$.

Beweis: $f^{-1}(f(x)) = \text{id}(x) = x$

Nach der Kettenregel folgt

$f(f^{-1}(y)) = \text{id}_y = y$
$df(\underbrace{f^{-1}(y)}_x) \circ df^{-1}(y) = I \quad \textcircled{2}$
$f(x) = df(x) \circ df^{-1}(f(x))$

$$I = d \text{id}(x) = d(f^{-1}(f(x))) = df^{-1}(f(x)) \circ df(x) \quad \textcircled{1}$$

$$\stackrel{\textcircled{1} + \textcircled{2}}{\Rightarrow} df^{-1}(f(x)) = [df(x)]^{-1} \quad \square$$

4.4 Satz Sei $f: D \rightarrow G$ ein Homomorphismus mit $f \in C^k(D, G)$. Die folgenden Aussagen sind aquivalent

(i) f ist ein C^k -Diffeomorphismus

(ii) $df(x): \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ ist fur jedes $x \in D$ ein Isomorphismus.

Beweis (i) \Rightarrow (ii) folgt aus Satz 4.3

(ii) \Rightarrow (i) z.z. $f^{-1} \in C^k(G, D)$:

Sei $y \in G$. Wahle k so klein, dass $y+k \in G$ und setze $x := f^{-1}(y), h := f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y)$.

Da $f \in C^k(D, Y)$

$$f(x+h) = f(x) + df(x)h + R(h) \quad \text{mit} \quad \lim_{h \rightarrow 0} \frac{R(h)}{\|h\|} = 0$$

$$\begin{aligned} f(f^{-1}(y) + f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y)) &= f(f^{-1}(y+k)) = y+k \\ &= f(f^{-1}(y)) + df(f^{-1}(y))(f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y)) + R(f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y)) \end{aligned}$$

$$-y \mid [df(x)]^{-1}$$

$$\Rightarrow [df(x)]^{-1} k = f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y) + [df(x)]^{-1} R(h)$$

$$\Rightarrow f^{-1}(y+k) = f^{-1}(y) + [df(x)]^{-1} k - \underbrace{[df(x)]^{-1} R(f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y))}_{=: R^*(k)} \quad (1)$$

Zu zeigen $\lim_{k \rightarrow 0} \frac{\|R^*(k)\|}{\|k\|} = 0$: $c := \|df(x)\|^{-1}$

f diffbar: $\exists r > 0 : \forall h \in B_r(0)$ gilt $\|R(h)\| \leq \frac{1}{2c} \|h\|$ (2)

f^{-1} stetig: $\exists \delta > 0 : \forall \|k\| \leq \delta : \|h\| = \|f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y)\| \leq r$ (3)

$$\Rightarrow \|R^*(k)\| \leq \| [df(x)]^{-1} \| \| R(f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y)) \|$$

$$\stackrel{(2)(3)}{\leq} \frac{1}{2} \| f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y) \| \quad \forall \|k\| \leq \delta \quad (4)$$

Ausgehend von (1) ergibt sich

$$\| f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y) \| \leq \| [df(x)]^{-1} \| \|k\| + \| R^*(k) \|$$

$$\stackrel{(4)}{\leq} \frac{1}{2} \| f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y) \|$$

$$\Rightarrow \| f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y) \| \leq 2 \| [df(x)]^{-1} \| \|k\|$$

Für $\|k\| \leq \delta, k \neq 0$ folgt:

$$\frac{\|R^*(k)\|}{\|k\|} \leq \| [df(x)]^{-1} \| \frac{\| f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y) \|}{\|k\|} \frac{\| R(f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y)) \|}{\| f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y) \|}$$

$$\leq 2 \| [df(x)]^{-1} \| \frac{\|R(h)\|}{\|h\|} \xrightarrow{k \rightarrow 0} 0,$$

da wegen der Stetigkeit von f^{-1} aus $k \rightarrow 0, h = f^{-1}(y+k) - f^{-1}(y) \rightarrow 0$ folgt.

Zu zeigen df^{-1} ist stetig:

$$df^{-1}(y) = [df(f^{-1}(y))]^{-1} \quad \text{nach (1)}$$

$\Rightarrow df^{-1} = \text{Inv} \circ df \circ f^{-1}$ eine Verkettung von stetigen Funktionen und somit auch selbst stetig.

$f \in C^k$ folgt per Induktion aus der Aussage für $f \in C^{k-1}$ \square

4.5 Umkehrsatz

Seien $D, G \subset \mathbb{R}^n$ offen, $f \in C^k(D, G)$, $a \in D$, $y_0 = f(a) \in G$.

Ist $df(a)$ ein Isomorphismus, so ist f ein lokaler C^k -Diffeomorphismus in a .

Beweis: Schritt 0: f vereinfachen

O.B.d.A. $a=0$ und $y_0=f(a)=0$. Andernfalls betrachte

$$\tilde{f}(x) := f(x+a) - y_0 \text{ mit } \tilde{f}(0) = f(a) - y_0 = y_0 - y_0 = 0$$

und $d\tilde{f}(0) = df(0+a) = df(a)$ ist Isomorphismus

O.B.d.A. $df(0) = id$ mit betrachte $\tilde{\tilde{f}}(x) := [df(0)]^{-1} \tilde{f}(x)$

$$\text{und dann ist } d\tilde{\tilde{f}}(x) = d[[df(0)]^{-1} \tilde{f}(x)] = [df(0)]^{-1} d\tilde{f}(x)$$

$$\Rightarrow d\tilde{\tilde{f}}(0) = [df(0)]^{-1} df(0) = I_n$$

Schritt 1: Betrachte $g_y(x) := y + x - f(x)$:

Konstr. einer
stetigen
Umkehr-
abbildung

$$\Rightarrow x = g_y(x) = y + x - f(x) \Leftrightarrow y = f(x), \text{ d.h. die}$$

Fixpunkte von g_y sind gleich die Urbilder von y unter f .

Wähle $r > 0$ so groß, dass $\overline{B_{2r}(0)} \subset D$ und

$$\|id_x - df(x)\| \leq \frac{1}{2} \quad \forall x, \|x\| \leq 2r \quad (1)$$

Das geht, da df stetig ist, denn $f \in C^1$.

Wegen $dg_y = id_x - df$ impliziert der Schrankenwert

für $x_1, x_2 \in \overline{B_{2r}(0)}$

$$\begin{aligned} \|g_y(x_2) - g_y(x_1)\| &\leq \sup_{t \in [0,1]} \|dg_y((1-t)x_1 + tx_2)\|_{op} \|x_2 - x_1\| \\ &\stackrel{(1)}{\leq} \frac{1}{2} \|x_2 - x_1\|, \quad \forall x_1, x_2 \in \overline{B_{2r}(0)} \quad (2) \end{aligned}$$

Damit folgt für $y \in B_r(0)$ und $x \in \overline{B_{2r}(0)}$

$$\|g_y(x)\| \leq \|g_y(x) - g_y(0)\| + \|y\| \stackrel{(2)}{\leq} \frac{1}{2} \|x - 0\| + \|y\| \leq \frac{1}{2} \cdot 2r + r = 2r \quad (3)$$

$\Rightarrow g_y(\overline{B_{2r}(0)}) \subset \overline{B_{2r}(0)} \quad \forall y \in B_r(0)$ und g_y ist eine Kontraktion mit $q \leq \frac{1}{2}$ nach (2). $\overline{B_{2r}(0)}$ ist als abg. Teilmenge eines vollständigen metrischen Raumes ebenfalls vollständig.

Nach dem Banachschen Fixpunktsatz hat jedes g_y genau einen Fixpunkt $x \in \overline{B_{2r}(0)}$ und dieser ist nach ③ in $B_{2r}(0)$ (offen).

$\Rightarrow \forall y \in B_r(0) \exists x \in B_{2r}(0)$ mit $g_y(x) = x \Leftrightarrow f(x) = y$.

Setze $h(y) := x$; $V := B_r(0)$, $U_0 := f^{-1}(V) \cap B_{2r}(0)$, $h: V \rightarrow U_0$.

Schritt 2: h ist stetig: Seien $y_1, y_2 \in V$ und $x_1 = h(y_1), x_2 = h(y_2)$

$$\begin{aligned} \Rightarrow x_2 - x_1 &= (0 + x_2 - f(x_2)) - (0 + x_1 - f(x_1)) + f(x_2) - f(x_1) \\ &= g_0(x_2) - g_0(x_1) + f(x_2) - f(x_1) \end{aligned}$$

$$\Rightarrow \|x_2 - x_1\| \stackrel{②}{\leq} \frac{1}{2} \|x_2 - x_1\| + \|f(x_2) - f(x_1)\| \quad | -\frac{1}{2} \|x_2 - x_1\| \quad | \cdot 2$$

$$\Rightarrow \|h(y_2) - h(y_1)\| \leq \|x_2 - x_1\| \leq 2 \|y_2 - y_1\|,$$

das heißt h ist Lipschitzstetig und insbesondere auch stetig.

Schritt 3: $df(x)$ ist ein Isomorphismus $\forall x \in U_0$:

Wegen der Wahl von r und $U_0 = f^{-1}(V) \cap B_{2r}(0) \subset B_{2r}(0)$

gilt $\|(\text{id}(x) - df(x))v\| \leq \frac{1}{2} \|v\| \quad \forall v \in \mathbb{R}^n$.

ist $df(x)v = 0 \Leftrightarrow \|v\| \leq \frac{1}{2} \|v\| \Leftrightarrow \|v\| = 0 \Leftrightarrow v = 0$

$\Rightarrow \ker df(x) = \{0\}$, das heißt $df(x)$ ist invertierbar.

Schritt 4

Nach Schritt 2 und 3 ist $(f|_{U_0})^{-1} = h$ stetig & $df(x)$

ist Isomorphismus $\forall x \in U_0 \xrightarrow{\text{Satz 4.4}} f|_{U_0}: U_0 \rightarrow V$ ist

Diffeomorphismus. ▣

Bemerkung: • $df(a)$ ist ein Isomorphismus genau

dann, wenn $\det J_f(a) \neq 0$.

• Der Satz besagt:

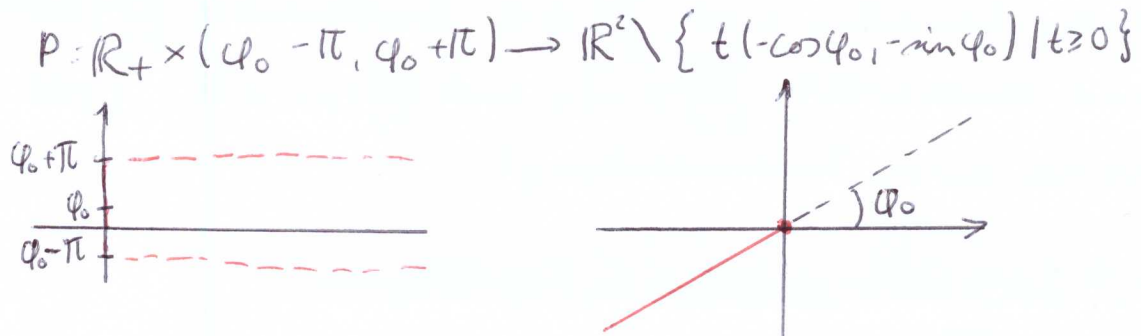
Hat $df(a)v = w$ eine eindeutige Lösung $v \quad \forall w \in \mathbb{R}^n$,
dh. $\det J_f(a) \neq 0 \Rightarrow f(x) = y$ lässt sich nahe bei a
bzw. y_0 eindeutig lösen.

4.6 Folgerung (Diffeomorphiesatz)

Seien $D, G \subset \mathbb{R}^n$ offen und sei $f \in C^k(D, G)$ bijektiv, $k \geq 1$. Falls $df(a)$ für jedes $a \in D$ invertierbar ist, so folgt $f^{-1} \in C^k(G, D)$, d.h. f ist ein C^k -Diffeomorphismus.

Beweis: klar.

Beispiel: Betrachte nochmal Polarkoordinatenabbildung



Für alle $(r, \varphi) \in \mathbb{R}_+ \times (\varphi_0 - \pi, \varphi_0 + \pi)$ gilt

$$J_P(r, \varphi) = \begin{pmatrix} \cos \varphi & -r \sin \varphi \\ \sin \varphi & r \cos \varphi \end{pmatrix} \Rightarrow \det J_P(r, \varphi) = r \neq 0$$

$\Rightarrow df(r, \varphi)$ ist für jedes $(r, \varphi) \in \mathbb{R}_+ \times (\varphi_0 - \pi, \varphi_0 + \pi)$ invertierbar. Außerdem ist P bijektiv (Hausaufgabe)

$\stackrel{4.6}{\Rightarrow} P: \mathbb{R}_+ \times (\varphi_0 - \pi, \varphi_0 + \pi) \rightarrow \mathbb{R}^2 \setminus \{t(-\cos\varphi_0, -\sin\varphi_0) \mid t \geq 0\}$ ist ein C^∞ -Diffeomorphismus.

Bemerkung: Ohne die Voraussetzung der Bijektivität ist der Diffeomorphiesatz falsch. Betrachte

$$f: \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}^2 \\ (x, y) \mapsto (e^x \cos y, e^x \sin y)$$

$$\Rightarrow J_f(x, y) = \begin{pmatrix} e^x \cos y & -e^x \sin y \\ e^x \sin y & e^x \cos y \end{pmatrix}$$

$$\Rightarrow \det J_f(x, y) = e^{2x} \cos^2 y + e^{2x} \sin^2 y = e^{2x} \neq 0 \quad \forall (x, y) \in \mathbb{R}^2$$

$$\text{Aber: } f(x, y + 2k\pi) = (e^x \cos(y + 2k\pi), e^x \sin(y + 2k\pi))$$

$$\forall k \in \mathbb{Z} \quad = (e^x \cos y, e^x \sin y) = f(x, y)$$

und f ist somit nicht injektiv.

Allerdings erfüllt f die Voraussetzungen des

Umkehrsatzes und ist somit ein lokaler Diffeomorphismus.

Satz über implizite Funktionen

Betrachte die Funktion $f: \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}, (x,y) \mapsto y-x^2$ und $(x_0, y_0) = (0,0), z_0 = 0$. Dann ist

$y-x^2=0$ auflösbar durch $y=g(x)=x^2$ bei $x_0=0$

Nach y kann die Gleichung nicht aufgelöst werden,

denn $x = \begin{cases} \pm\sqrt{y} & y \geq 0 \\ \text{nicht def.} & y < 0 \end{cases}$ mehrdeutig und nicht diffbar in 0.

Dazu bemerken wir $\frac{\partial f}{\partial y} = 1$ insbesondere $\frac{\partial f}{\partial y}(0,0) = 1 \neq 0$ und andererseits $\frac{\partial f}{\partial x} = -2x$ und $\frac{\partial f}{\partial x}(0,0) = 0$. Gibt es da einen Zusammenhang?

4.7 Satz über implizite Funktionen

Sei $U \subset \mathbb{R}^{k+m}$ offen, $f \in C^r(U, \mathbb{R}^m)$, $(x_0, y_0) \in U$, $z_0 = f(x_0, y_0)$.

Sei $d_y f(x_0, y_0)$ definiert durch

$$d_y f(x_0, y_0) \underset{\mathbb{R}^m}{\tilde{h}} := df(x_0, y_0)(0, \tilde{h}) \in \mathbb{R}^m.$$

Angenommen $d_y f(x_0, y_0)$ ist invertierbar. Dann gibt es eine offene Umgebung der Form $V \times W \subset U$ von (x_0, y_0) und eine Abbildung $g \in C^r(V, W)$ mit $g(x_0) = y_0$ so, dass für alle $(x, y) \in V \times W$ gilt:

$$f(x, y) = z_0 \iff y = g(x) \quad \forall (x, y) \in V \times W$$

Beweis: Betrachte $\Phi: U \rightarrow \mathbb{R}^{k+m}$, $\Phi(x, y) = (x, f(x, y))$

$$\Rightarrow d\Phi(x_0, y_0)[h, k] = (d(\text{id}_x)(x_0, y_0)[h, k], df(x_0, y_0)[h, k])$$

$$= (\text{Id}[h] + 0[k], df(x_0, y_0)[h, 0] + df(x_0, y_0)[0, k])$$

$$= (h, d_x f(x_0, y_0)h + d_y f(x_0, y_0)k)$$

$$= \begin{pmatrix} \text{Id} & 0 \\ d_x f(x_0, y_0) & d_y f(x_0, y_0) \end{pmatrix} \begin{pmatrix} h \\ k \end{pmatrix}$$

$\Rightarrow \det d\Phi(x_0, y_0) = \det d_y f(x_0, y_0) \neq 0$ nach Voraussetzung

$\Rightarrow d\Phi(x_0, y_0)$ ist ein Isomorphismus

Nach dem Umkehrsatz 4.5 gibt es eine Umgebung

D von (x_0, y_0) und g von $\Phi(x_0, y_0) = (x_0, z_0)$ derart, dass

$\Phi: D \rightarrow Y$ ein C^k -Diffeomorphismus ist mit $\Phi^{-1}: Y \rightarrow D$. Wegen der besonderen Struktur von Φ gibt es ein $h \in C^k(Y, \mathbb{R}^m)$, so dass für $(\xi, \eta) \in Y$ folgt

$$\Phi^{-1}(\xi, \eta) = (\xi, h(\xi, \eta))$$

Für ein $(x, y) \in D$ gilt:

$$f(x, y) = z_0 \Leftrightarrow \Phi(x, y) = (x, f(x, y)) = (x, z_0)$$

$$\Leftrightarrow (x, y) = \Phi^{-1}(x, z_0) = (x, h(x, z_0)) \Leftrightarrow y = h(x, z_0)$$

Inbesondere gilt $h(x_0, z_0) = y_0$.

$\stackrel{h \text{ stetig}}{\Rightarrow} \exists$ eine Umgebung V von x_0 und eine Umgebung W von y_0 mit $V \times W \subset Y$ und so, dass für $x \in V$ $h(x, z_0)$ in W liegt.

Def. $g: V \rightarrow W$ durch $g(x) = h(x, z_0)$. Dieses g hat die gewünschten Eigenschaften. \square