

Сходимость ряда Фурье

Волченко Ю.М.

Содержание лекции

Сходимость в среднем. Условие сходимости в среднем ряда Фурье. Равномерная и поточечная сходимости ряда Фурье. Минимальность частичной суммы ряда Фурье. Неравенство Бесселя и равенство Парсеваля. Физический смысл равенства Парсеваля.

Анимация равномерной сходимости ряда Фурье.

Анимация работает только в программе Acrobat Reader!

27 января 2016 г.

1 Сходимость в среднем

В последнем примере прошлой лекции было обнаружено своеобразное поведение частичных сумм ряда Фурье, которое наводило на мысль, что в примере наблюдается какой-то новый тип сходимости. Это предположение было подтверждено в свое время математической наукой, которая назвала новый вид сходимости сходимостью в среднем.

Говорят, что на отрезке $[a, b]$ **последовательность функций** f_1, f_2, \dots **сходится в среднем** к функции f , если

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \|f_n - f\| = \lim_{n \rightarrow \infty} \left(\int_a^b [f_n(t) - f(t)]^2 dt \right)^{1/2} = 0.$$

Говорят, что **функциональный ряд сходится в среднем** к функции $f(t)$ на отрезке $[a, b]$, если последовательность его частичных сумм сходится в среднем к $f(t)$ на этом отрезке.

Теорема 1. *Если последовательность функций f_1, f_2, \dots , сходится равномерно к функции f на отрезке $[a, b]$, то эта последовательность сходится и в среднем к f на $[a, b]$.*

Доказательство. Возьмем произвольное число $\varepsilon > 0$. Для положительного числа $\sqrt{\varepsilon/[2(b-a)]}$ в силу равномерной сходимости найдется такой номер N , что для всех $n \geq N$ и для всех $t \in [a, b]$ выполнится неравенство

$$|f_n - f| < \sqrt{\frac{\varepsilon}{2(b-a)}}.$$

Но тогда для всех $n \geq N$

$$\|f_n - f\| = \left(\int_a^b [f_n(t) - f(t)]^2 dt \right)^{1/2} \leq \frac{\varepsilon}{2(b-a)} \int_a^b dt = \frac{\varepsilon}{2} < \varepsilon.$$

□

Обратное утверждение неверно. Чтобы убедиться в этом, рассмотрим следующий

Пример 1. Показать, что последовательность функций $f_n(t) = t^n$ не сходится к функции $f \equiv 0$ на отрезке $[0; 1]$, но сходится к ней в среднем.

Решение. Действительно, сходимость в среднем имеет место:

$$\|f_n - f\|^2 = \int_0^1 (t^n - 0)^2 dt = \frac{t^{2n+1}}{2n+1} \Big|_0^1 = \frac{1}{2n+1} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0.$$

Но $f_n(1) = 1$ и, значит, $\lim_{n \rightarrow \infty} f_n(1) \not\rightarrow 0$. Поскольку последовательность не сходится к $f \equiv 0$, то она не сходится и равномерно. □

Этот пример служит некоторым объяснением своеобразной сходимости, наблюдавшейся в примере из прошлой лекции. Мы видим, что расходимость последовательности функций в одной точке (и даже в нескольких) не влияет на ее сходимость в среднем. Так что торчащие на рис. к упомянутому примеру «ушки», которые серьезные люди называют явлением Гиббса, не противоречат тому, что ряд Фурье, быть может, сходится к функции $f(t)$ в среднем. А, действительно, сходится ли он в среднем?

Теорема 2. Тригонометрический ряд Фурье любой кусочно непрерывной на отрезке $[-l, l]$ функции $f(t)$ сходится на этом отрезке к указанной функции в среднем.

Очевидно, функция из последнего примера прошлой лекции удовлетворяет условиям теоремы, и поэтому ее ряд Фурье сходится к ней в среднем.

Оказывается, если функция $f(t)$ непрерывна, то сходимость становится даже равномерной, и явление Гиббса уже наблюдаться не будет. Чтобы сформулировать соответствующее утверждение, введем новые определения.

Функция $f(t)$ называется **кусочно гладкой** на отрезке $[a, b]$, если она сама и ее производная $f'(t)$ непрерывны на этом отрезке, за исключением, быть может, конечного числа точек разрыва I рода.

Теорема 3. Если функция $f(t)$ непрерывна и кусочно гладка на отрезке $[-l, l]$ и выполняется условие $f(-l) = f(l)$, то тригонометрический ряд Фурье функции $f(t)$ сходится к ней на $[-l, l]$ абсолютно и равномерно.

Доказательство приведено в Приложении¹).

Пример 2. Разложить в ряд Фурье 2π -периодическую функцию $f(t) = |t|$, заданную на отрезке $[-\pi, \pi]$ и изображенную на рис. 1.

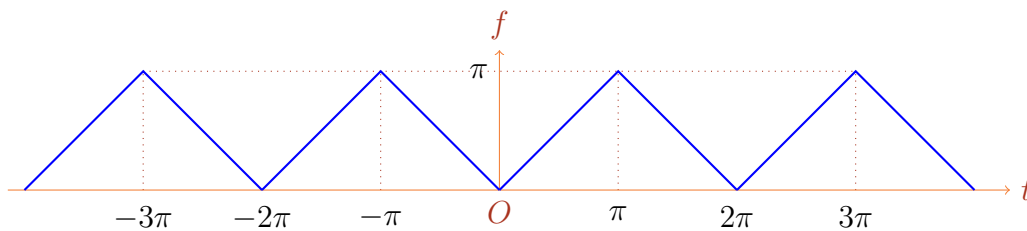


Рис. 1.

Решение. Заданная функция четна, поэтому коэффициенты Фурье вычислим по формулам для четных функций:

$$\begin{aligned}
 a_0 &= \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(t) dt = \frac{2}{\pi} \int_0^{\pi} t dt = \frac{t^2}{\pi} \Big|_0^{\pi} = \pi; \\
 a_k &= \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(t) \cos kt dt = \frac{2}{\pi} \int_0^{\pi} t \cos kt dt = \\
 &= \left\langle u = t, dv = \cos kt dt, du = dt, v = \frac{1}{k} \sin kt \right\rangle = \\
 &= \frac{2}{k\pi} t \sin kt \Big|_0^{\pi} - \frac{2}{k\pi} \int_0^{\pi} \sin kt dt = \frac{2}{k^2\pi} \cos kt \Big|_0^{\pi} = \\
 &= \frac{2}{k^2\pi} (\cos k\pi - 1) = \frac{2}{k^2\pi} [(-1)^k - 1] = \\
 &= \begin{cases} 0, & k = 2m; \\ -\frac{4}{k^2\pi}, & k = 2m + 1; m = 0, 1, 2, \dots; \end{cases} \\
 b_k &= 0.
 \end{aligned}$$

Следовательно,

$$f(t) = \frac{\pi}{2} - \frac{4}{\pi} \sum_{m=0}^{\infty} \frac{\cos(2m+1)t}{(2m+1)^2}.$$

Анимационный рис. 2 показывает, что для заданной функции явление Гиббса отсутствует, а скорость сходимости частичных сумм ряда Фурье к функции $f(t)$ на порядок

выше, чем в аналогичном примере с анимацией прошлой лекции. Первое объясняется равномерной сходимостью ряда Фурье для кусочно гладкой функции, а второе — тем, что знаменатели дробей убывают как квадраты чисел $2m + 1$, в то время как в примере 3 предыдущей лекции они убывали линейно.

Рис. 2. Аппроксимация пилообразного сигнала рядом Фурье.

□

Наконец, существуют теоремы о поточечной сходимости ряда Фурье, уточняющие особенности поведения его частичных сумм. Чтобы сформулировать одну из них, добавим еще одно определение.

Функция $f(t)$ называется **кусочно монотонной** на отрезке $[a, b]$, если этот отрезок можно разбить конечным числом точек t_1, t_2, \dots, t_{n-1} на интервалы $(a, t_1), (t_1, t_2), \dots, (t_{n-1}, b)$, в каждом из которых функция $f(t)$ монотонна (только убывает или только возрастает). Пример кусочно монотонной функции показан на рис. 3.

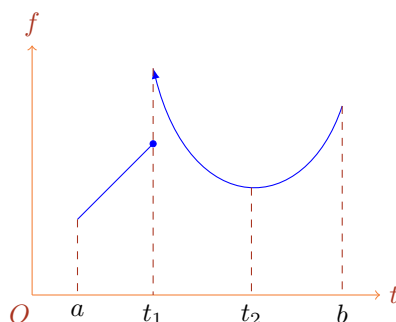


Рис. 3. Кусочно монотонная функция.

Одно из доказанных ранее утверждений[†] приводит к выводу, что кусочно монотонная и ограниченная на некотором отрезке функция может иметь на нем точки разрыва только I рода.

Теорема 4. Если $2l$ -периодическая функция $f(t)$ кусочно монотонна и ограничена на $[-l, l]$, то ряд Фурье

$$\frac{a_0}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} \left(a_n \cos \frac{n\pi t}{l} + b_n \sin \frac{n\pi t}{l} \right) \quad (1)$$

этой функции сходится во всех точках. Сумма полученного ряда $S(t)$ равна значению функции $f(t)$ в точках ее непрерывности, а в точках разрыва $t = c$ — среднему арифметическому ее пределов слева и справа:

$$S(c) = \frac{f(c-0) + f(c+0)}{2}.$$

В каждом принадлежащем отрезку $[-l, l]$ интервале, в котором $f(t)$ непрерывна, ряд (1) сходится равномерно.

Таким образом, при выполнении условий теоремы сумма $S(t)$ принадлежит классу функций $F_{[-l, l]}$.

2 Минимальность частичной суммы ряда Фурье

Пусть $\{\varphi_n\}$ — ортогональная система функций. Для упрощения дальнейших выкладок рассмотрим также **ортонормированную систему** $\{\psi_n\}$, для которой $\|\psi_n\| = 1$. Ортогональную систему $\{\varphi_n\}$ можно сделать ортонормированной, если ее **нормировать**, т.е. положить

$$\psi_n = \frac{\varphi_n}{\|\varphi_n\|}.$$

Ряд Фурье по ортогональной системе мы записывали как $\sum_{n=0}^{\infty} c_n \varphi_n$, а тогда по ортонормированной системе он запишется в виде

$$\sum_{n=0}^{\infty} d_n \psi_n = \sum_{n=0}^{\infty} d_n \frac{\varphi_n}{\|\varphi_n\|}.$$

Отсюда получаем связь коэффициентов Фурье для ортогональной и ортонормированной систем:

$$d_n = c_n \|\varphi_n\|. \quad (2)$$

[†]Лекция «Непрерывность функции».

Назовем величину $\|f - g\|$ **отклонением** функции f от функции g .

Теорема 5. Пусть система функций $\{\psi_n\}$ ортонормирована. Среди всех сумм вида

$$\sum_{n=0}^N \alpha_n \psi_n(t)$$

с произвольными коэффициентами α_n наименьшее отклонение от функции $f(t)$ имеет N -я частичная сумма ряда Фурье

$$\sum_{n=0}^N d_n \psi_n(t).$$

Доказательство. Из ортонормированности системы $\{\psi_n\}$ следует, что формула вычисления коэффициентов Фурье

$$c_k = \frac{\int_a^b \psi_k(t) f(t) dt}{\int_a^b \psi_k^2(t) dt}$$

принимает вид $d_k = (f, \psi_k)$. Пользуясь свойствами интеграла, определяющего введенное скалярное произведение, получим

$$\begin{aligned} \left\| \sum_{n=0}^N \alpha_n \psi_n - f \right\|^2 &= \left(\sum_{n=0}^N \alpha_n \psi_n - f, \sum_{n=0}^N \alpha_n \psi_n - f \right) = \\ &= \sum_{n=0}^N \alpha_n^2 (\psi_n, \psi_n) - 2 \sum_{n=0}^N \alpha_n (f, \psi_n) + (f, f) = \\ &= \sum_{n=0}^N \alpha_n^2 - 2 \sum_{n=0}^N \alpha_n d_n + \|f\|^2, \end{aligned}$$

или

$$\left\| \sum_{n=0}^N \alpha_n \psi_n - f \right\|^2 = \sum_{n=0}^N (\alpha_n - d_n)^2 + \|f\|^2 - \sum_{n=0}^N d_n^2. \quad (3)$$

Мы видим, что квадрат отклонения будет минимальным только при $\alpha_n = d_n$.

3 Неравенство Бесселя и равенство Парсеваля

Если в формуле (3) положить $\alpha_n = d_n$, то получится равенство

$$\left\| \sum_{n=0}^N d_n \psi_n - f \right\|^2 = \|f\|^2 - \sum_{n=0}^N d_n^2,$$

которое называется **тождеством Бесселя**. Оно, в свою очередь, влечет за собой неравенство

$$\sum_{n=0}^N d_n^2 \leq \|f\|^2.$$

Если при $N \rightarrow \infty$ реализовать в последнем предельный переход, приходим к неравенству

$$\sum_{n=0}^{\infty} d_n^2 \leq \|f\|^2,$$

называемому **неравенством Бесселя**. При определенных условиях это неравенство переходит в равенство

$$\sum_{n=0}^{\infty} d_n^2 = \|f\|^2,$$

которое носит название **равенства Парсеваля**.

Для ортогональной системы $\{\varphi_k\}$ в силу формулы (2) неравенство Бесселя принимает вид

$$\sum_{n=0}^{\infty} c_n^2 \|\varphi_n\|^2 \leq \|f\|^2, \quad (4)$$

а равенство Парсеваля становится таким:

$$\|f\|^2 = \sum_{n=0}^{\infty} c_n^2 \|\varphi_n\|^2.$$

Свяжем найденные соотношения с тригонометрическим рядом (1). Для этого надо только вспомнить, что квадраты норм системы функций

$$1, \cos \frac{\pi t}{l}, \sin \frac{\pi t}{l}, \cos \frac{2\pi t}{l}, \sin \frac{2\pi t}{l}, \dots, \cos \frac{k\pi t}{l}, \sin \frac{k\pi t}{l}, \dots,$$

мы уже вычислили раньше:

$$\|1\|^2 = 2l, \quad \left\| \cos \frac{k\pi t}{l} \right\|^2 = \left\| \sin \frac{k\pi t}{l} \right\|^2 = l.$$

Следовательно, неравенство Бесселя (4) в этом случае записывается как

$$\left(\frac{a_0}{2}\right)^2 2l + \sum_{n=1}^{\infty} (a_n^2 l + b_n^2 l) \leq \|f\|^2,$$

или

$$\frac{a_0^2}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} (a_n^2 + b_n^2) \leq \frac{1}{l} \int_{-l}^l f^2(t) dt, \quad (5)$$

а равенство Парсеваля – как

$$\frac{1}{l} \int_{-l}^l f^2(t) dt = \frac{a_0^2}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} (a_n^2 + b_n^2). \quad (6)$$

Теорема 6. Для любой ограниченной и кусочно монотонной на $[-l, l]$ функции $f(t)$ справедливо равенство Парсеваля (6).

Равенство Парсеваля для разложения

$$f(t) = A_0 \cos(0t + \varphi_0) + \sum_{n=1}^{\infty} A_n \cos\left(\frac{k\pi}{l} t + \varphi_n\right),$$

преобразуется в

$$\frac{1}{l} \int_0^l f^2(t) dt = A_0^2 + \frac{1}{2} \sum_{n=1}^{\infty} A_n^2,$$

поскольку $f^2(t)$ четна, $A_0 = |a_0|/2$, $A_n^2 = a_n^2 + b_n^2$. Как показывает следующий пример, в этом виде оно приобретает важный физический смысл.

Пример 3. Пусть по проводнику с сопротивлением R течет ток $i(t)$ с периодом T . Разложим его на гармоники:

$$i(t) = I_0 \cos \varphi_0 + \sum_{n=1}^{\infty} I_n \cos(\omega_n t + \varphi_n). \quad (7)$$

Равенство Парсеваля для этого разложения после умножения на R записывается как

$$\frac{1}{T} \int_0^T i^2(t) R dt = I_0^2 R + \sum_{n=1}^{\infty} \frac{I_n^2 R}{2}.$$

Левая часть равенства представляет собой среднюю мощность тока $i(t)$ за период. Первое слагаемое $I_0^2 R$ в правой части является мощностью постоянной составляющей тока в формуле (7), а остальные слагаемые $I_n^2 R/2$ равны средней мощности

$$\frac{I_n^2 R}{T} \int_0^T \cos^2(\omega_n t + \varphi_n) dt$$

гармонических компонент $I_n \cos(\omega_n t + \varphi_n)$ за период. Действительно,

$$\begin{aligned} \frac{I_n^2 R}{T} \int_0^T \cos^2(\omega_n t + \varphi_n) dt &= \frac{I_n^2 R}{2T} \int_0^T [1 + \cos(2\omega_n t + 2\varphi_n)] dt = \\ &= \frac{I_n^2 R}{2T} \left[t + \frac{1}{2\omega_n} \sin(2\omega_n t + 2\varphi_n) \right] \Big|_0^T = \frac{I_n^2 R}{2}. \end{aligned}$$

Приложение

1) Все дальнейшие рассуждения будут относиться не к последовательности функций

$$1, \cos \frac{\pi t}{l}, \sin \frac{\pi t}{l}, \cos \frac{2\pi t}{l}, \sin \frac{2\pi t}{l}, \dots, \cos \frac{k\pi t}{l}, \sin \frac{k\pi t}{l}, \dots, \quad (\text{П1})$$

а к последовательности

$$1, \cos t, \sin t, \cos 2t, \sin 2t, \dots, \cos kt, \sin kt, \dots,$$

которая получается из (П1) заменой $t \rightarrow lt/\pi$; при этом отрезок $[-l, l]$, на котором рассматривается последовательность (П1), заменяется отрезком $[-\pi, \pi]$. Затем полученные выводы можно перенести на последовательность (П1), сделав обратную замену $t \rightarrow \pi t/l$.

Прежде всего отметим, что для скалярного произведения двух функций f и g справедливо неравенство Коши-Буняковского:

$$(f, g)^2 \leq (f, f) \cdot (g, g). \quad (\text{П2})$$

Доказывается этот факт с использованием свойств интеграла по той же схеме, что и для всякого евклидова пространства.

Лемма П1. Для нормы функции справедливо неравенство треугольника

$$\|f + g\| \leq \|f\| + \|g\|. \quad (\text{П3})$$

Доказательство. Перепишем неравенство Коши-Буняковского (П2) в виде

$$|(f, g)| \leq \sqrt{(f, f)} \cdot \sqrt{(g, g)} = \|f\| \cdot \|g\|.$$

Используя это соотношение и свойства интеграла, получим

$$\begin{aligned} \|f + g\| &= \sqrt{(f + g, f + g)} = \sqrt{\|f\|^2 + 2(f, g) + \|g\|^2} \leq \\ &\leq \sqrt{\|f\|^2 + 2\|f\| \cdot \|g\| + \|g\|^2} = \sqrt{(\|f\| + \|g\|)^2} = \|f\| + \|g\|. \end{aligned}$$

□

Теперь докажем следующее утверждение.

Теорема П1. Если тригонометрический ряд Фурье кусочно непрерывной на отрезке $[-\pi, \pi]$ функции $f(t)$ сходится равномерно на $[-\pi, \pi]$, то он сходится на $[-\pi, \pi]$ именно к $f(t)$.

Доказательство. Так как тригонометрический ряд Фурье сходится равномерно на $[-\pi, \pi]$, то в силу теоремы 1 он сходится на этом отрезке и в среднем. Пусть $S(t)$ — сумма этого ряда. Сходимость в среднем означает, что

$$\forall(\varepsilon > 0) \exists(N_1 \in \mathbf{N}) \forall(n \geq N_1) \|S(t) - S_n(t)\| < \frac{\varepsilon}{2},$$

где $S_n(t)$ — частичная сумма тригонометрического ряда Фурье.

С другой стороны, из теоремы 2 следует, что последовательность частичных сумм $S_n(t)$ сходится к функции $f(t)$ в среднем. То есть справедливо, что

$$\forall(\varepsilon > 0) \exists(N_2 \in \mathbf{N}) \forall(n \geq N_2) \|S_n(t) - f(t)\| < \frac{\varepsilon}{2}.$$

Из двух последних неравенств и неравенства треугольника (ПЗ) получим

$$\|S(t) - f(t)\| \leq \|S(t) - S_n(t)\| + \|S_n(t) - f(t)\| < \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon}{2} = \varepsilon.$$

Произвольность $\varepsilon > 0$ позволяет сделать вывод, что $\|S(t) - f(t)\| = 0$. Если $f(t) \in F_{[-\pi, \pi]}$, то, как было доказано на предыдущей лекции, $S(t) \equiv f(t)$.

На той же лекции был упомянут другой подход, заключающийся в отождествлении функций f и g , для которых $\|f(t) - g(t)\| = 0$. В этом случае можно показать, что $S(t)$ и $f(t)$ представляют собой функции, отличающиеся друг от друга лишь в отдельных точках. \square

Перейдем непосредственно к доказательству теоремы 3. Пусть α_n и β_n — коэффициенты тригонометрического ряда Фурье для производной $f'(t)$. Применим к формулам вычисления коэффициентов Фурье для функции $f(t)$ интегрирование по частям:

$$\begin{aligned} a_k &= \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(t) \cos kt \, dt = \left\langle u = f(t), dv = \cos kt \, dt, du = f'(t) \, dt, v = \frac{1}{k} \sin kt \right\rangle = \\ &= \frac{1}{k\pi} f(t) \sin kt \Big|_{-\pi}^{\pi} - \frac{1}{k\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f'(t) \sin kt \, dt = -\frac{1}{k\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f'(t) \sin kt \, dt, \\ b_k &= \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(t) \sin kt \, dt = \left\langle u = f(t), dv = \sin kt \, dt, du = f'(t) \, dt, v = -\frac{1}{k} \cos kt \right\rangle = \\ &= -\frac{1}{k\pi} f(t) \cos kt \Big|_{-\pi}^{\pi} + \frac{1}{k\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f'(t) \cos kt \, dt = \frac{1}{k\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f'(t) \cos kt \, dt. \end{aligned}$$

Таким образом, справедливы равенства

$$a_k = -\frac{\beta_k}{k}, \quad b_k = \frac{\alpha_k}{k}. \quad (\text{П4})$$

Здесь мы забежим немного вперед и воспользуемся неравенством Бесселя (5), оправдываясь тем, что вывод указанного неравенства никак не связан с доказываемыми сейчас утверждениями. Так вот из неравенства Бесселя следует, что ряд

$$\sum_{k=1}^{\infty} (a_k^2 + b_k^2) \quad (\text{П5})$$

сходится, поскольку существует и конечен интеграл, стоящий в правой части неравенства. Последнее справедливо в силу того, что всякая кусочно гладкая функция ограничена и имеет ограниченную производную во всех точках, за исключением угловых точек и точек разрыва.

Примем во внимание соотношения

$$\begin{aligned} \left(|\alpha_k| - \frac{1}{k} \right)^2 &= \alpha_k^2 - \frac{2|\alpha_k|}{k} + \frac{1}{k^2} \geq 0, \\ \left(|\beta_k| - \frac{1}{k} \right)^2 &= \beta_k^2 - \frac{2|\beta_k|}{k} + \frac{1}{k^2} \geq 0, \end{aligned}$$

из которых следует, что

$$\frac{|\alpha_k|}{k} + \frac{|\beta_k|}{k} \leq \frac{1}{2}(\alpha_k^2 + \beta_k^2) + \frac{1}{k^2}.$$

В правой части стоят члены сходящихся рядов (П5) и $\sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k^2}$, поэтому сходится и ряд

$$\sum_{k=1}^{\infty} \left(\frac{|\alpha_k|}{k} + \frac{|\beta_k|}{k} \right).$$

Тогда в силу (П4) сходится ряд

$$\sum_{k=1}^{\infty} (|a_k| + |b_k|). \quad (\text{П6})$$

Следовательно, тригонометрический ряд

$$\frac{a_0}{2} + \sum_{k=1}^{\infty} (a_k \cos kt + b_k \sin kt)$$

сходится абсолютно и равномерно, поскольку мажорируется рядом (П6):

$$|a_k \cos kt + b_k \sin kt| \leq |a_k \cos kt| + |b_k \sin kt| \leq |a_k| + |b_k|.$$

Отсюда в силу теоремы П1 и получается заключение доказываемой теоремы.

Литература

- [1] Бугров Я.С., Никольский С.М. *Высшая математика. Дифференциальные уравнения. Кратные интегралы. Ряды. Функции комплексного переменного*. — М.: Наука, 1985, — с. 266-268, 271-275, 278-291.
- [2] Письменный Д.Т. *Конспект лекций по высшей математике*. — М.: Рольф, 2000. Ч. 2. — с. 148.
- [3] Толстов Г.П. *Ряды Фурье*. — М.: Физматгиз, 1960, — с. 30-35, 70-122.