

Asupra inegalităților de convexitate în absența derivabilității

CONSTANTIN P. NICULESCU*

Universitatea din Craiova, Facultatea de matematică-informatică, Craiova 1100

1. INTRODUCERE

Funcțiile convexe se bucură de o serie de proprietăți geometrice, care le fac deosebit de utile în aplicațiile analizei matematice. Acestea sunt prezentate adesea în ipoteza suplimentară de derivabilitate, o restricție pe care nota de față își propune să o elimine. În particular, vom da o nouă perspectivă unor rezultate publicate anterior de V. Cârtoaje [1] și M. O. Drimbe [2].¹

În cele ce urmează, I desemnează un interval nevid. Reamintim că o funcție $f : I \rightarrow \mathbb{R}$ este numită *funcție convexă* dacă

$$f(\alpha_1 x_1 + \alpha_2 x_2) \leq \alpha_1 f(x_1) + \alpha_2 f(x_2)$$

pentru orice $x_1, x_2 \in I$ și orice $\alpha_1, \alpha_2 \in [0, 1]$, cu $\alpha_1 + \alpha_2 = 1$.

Este binecunoscut că orice funcție convexă f definită pe un interval deschis I este continuă, are derivate laterale finite în orice punct și

$$x < y \text{ în } I \text{ implică } f'_s(x) \leq f'_d(x) \leq f'_s(y) \leq f'_d(y). \quad (*)$$

În particular, atât f'_s cât și f'_d sunt funcții crescătoare. Deoarece mulțimea punctelor de discontinuitate ale unei funcții crescătoare este cel mult numărabilă, rezultă de aici că orice funcție convexă este derivabilă, exceptând o submulțime cel mult numărabilă de puncte. Toate aceste proprietăți sunt demonstrate de exemplu în monografia autorului [5].

Locul derivatei în cazul funcțiilor convexe este jucat de subdiferențială, un obiect care poate fi prezentat fie ca mulțime de funcții, fie ca aplicație multivocă. Vom opta pentru prima variantă, care ni se pare mai naturală.

Prin definiție, *subdiferențiala* unei aplicații $f : I \rightarrow \mathbb{R}$ este mulțimea

$$\partial f = \{\varphi : I \rightarrow \mathbb{R} \mid f(x) \geq f(a) + (x - a)\varphi(a), \forall x, a \in I\}.$$

*Articol publicat în *Gazeta Matematică*, publicație lunară pentru tineret, **CIII** (1998), no. 9, pp. 329-337.

¹După publicarea acestei lucrări am constatat că de fapt nota d-lui M. O. Drimbe [2] prezenta (fără să facă vreo mențiune) un rezultat al lui S. S. Dragomir și N. M. Ionescu din lucrarea lor *Some converse of Jensen's inequality and applications*, Rev. Anal. Numér. Théor. Approx. **23** (1994), 71-78.

Interpretarea geometrică a subdiferențialei este aceea că dreapta de coeficient unghiular $\varphi(a)$, care trece prin punctul $(a, f(a))$, se află sub graficul lui f . Acest fapt conduce la următoarea caracterizare a funcțiilor convexe, binecunoscută specialiștilor din domeniul analizei convexe:

Lema 1. *Fie I un interval și fie $f : I \rightarrow \mathbb{R}$ o funcție definită pe I .*

i) *Presupunem că intervalul I este deschis. Atunci subdiferențiala ∂f este nevidă dacă și numai dacă f este convexă. În plus, dacă $\varphi \in \partial f$, atunci*

$$f'_s(x) \leq \varphi(x) \leq f'_d(x)$$

pentru orice $x \in I$; în particular, φ este o funcție crescătoare.

ii) *În cazul unui interval oarecare I , subdiferențiala ∂f este nevidă dacă și numai dacă f este restricția unei funcții convexe definite pe un interval deschis care îl include pe I .*

Demonstrație. i) Pentru partea de necesitate este suficient să arătăm că dacă f este o funcție convexă atunci atât f'_s cât și f'_d aparțin lui ∂f . Vom detalia aici doar faptul că $f'_d \in \partial f$.

Fie $x, a \in I$ și presupunem că $x > a$. Pentru orice $t \in (0, 1]$ avem

$$f((1-t)a + tx) \leq (1-t)f(a) + tf(x)$$

de unde rezultă

$$f(x) \geq f(a) + \frac{f(a + t(x-a)) - f(a)}{t(x-a)} \cdot (x-a)$$

iar prin trecere la limita cu $t \rightarrow 0+$, de aici deducem că $f(x) \geq f(a) + f'_d(a)(x-a)$. Dacă $x < a$, atunci un raționament similar ne dă

$$f(x) \geq f(a) + f'_s(a)(x-a) \geq f(a) + f'_d(a)(x-a)$$

deoarece $x < a$.

Faptul că funcția φ este crescătoare rezultă acum din relația (*).

Pentru partea de suficiență, să notăm că dacă $\varphi \in \partial f$, atunci pentru orice două puncte $x, y \in I$ și orice $\lambda \in [0, 1]$ avem

$$\begin{aligned} f(x) &\geq f((1-\lambda)x + \lambda y) + \lambda(x-y)\varphi((1-\lambda)x + \lambda y) \\ f(y) &\geq f((1-\lambda)x + \lambda y) - (1-\lambda)(x-y)\varphi((1-\lambda)x + \lambda y) \end{aligned}$$

de unde, adunând prima relație înmulțită cu $1-\lambda$ cu a doua înmulțită cu λ deducem că

$$(1-\lambda)f(x) + \lambda f(y) \geq f((1-\lambda)x + \lambda y).$$

Punctul ii) rezultă din i). ■

În paginile Gazetei Matematice, o parte din rezultatul Lemei 1 a făcut obiectul notei [7], fără a se conștientiza însă că este vorba de un întreg domeniu deja dezvoltat.

2. PRECIZAREA INEGALITĂȚII LUI JENSEN

Scopul acestei secțiuni este acela de a demonstra inegalități care să evalueze precizia în binecunoscuta inegalitate a lui Jensen. O primă variantă este următoarea:

Teorema 1. *Fie I un interval deschis, fie $f : I \rightarrow \mathbb{R}$ o funcție convexă și fie $\varphi \in \partial f$. Atunci*

$$\begin{aligned} 0 &\leq \sum_{k=1}^n \alpha_k f(x_k) - f\left(\sum_{k=1}^n \alpha_k x_k\right) \leq \\ &\leq \sum_{k=1}^n \alpha_k x_k \varphi(x_k) - \left(\sum_{k=1}^n \alpha_k x_k\right) \left(\sum_{k=1}^n \alpha_k \varphi(x_k)\right) \end{aligned}$$

pentru orice $x_1, \dots, x_k \in I$ și orice $\alpha_1, \dots, \alpha_n \in [0, 1]$, cu $\sum_{k=1}^n \alpha_k = 1$.

Să notăm că prima inegalitate este aceea a lui Jensen, care apoi este precizată de inegalitatea lui Cebâșev, aplicată perechii de funcții crescătoare φ și identitatea lui I .

Demonstrație. Conform definiției lui ∂f avem

$$f(x) \geq f(x_k) + (x - x_k)\varphi(x_k)$$

pentru orice $x \in I$ și orice $k \in \{1, \dots, n\}$. Înmulțind ambii membri cu α_k , adunând inegalitățile și particularizând rezultatul obținut pentru $x = \sum_{k=1}^n \alpha_k x_k$, deducem a doua inegalitate din enunț. ■

Putem preciza inegalitatea lui Jensen și altfel:

Teorema 2. *Fie $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ o funcție convexă și continuă, care admite derivată la dreapta finită în punctul a . Fie $\alpha_1, \dots, \alpha_n \in [0, 1]$ cu $\sum_{k=1}^n \alpha_k = 1$ și fie $[m_1, M_1], \dots, [m_n, M_n]$ subintervale compacte incluse în intervalul $[a, b]$. Atunci funcția*

$$E(x_1, \dots, x_n) = \sum_{k=1}^n \alpha_k f(x_k) - f\left(\sum_{k=1}^n \alpha_k x_k\right)$$

definită pe $[m_1, M_1] \times \dots \times [m_n, M_n]$ își atinge maximul într-un punct din $\{m_1, M_1\} \times \dots \times \{m_n, M_n\}$. Mai general, oricare ar fi Ω un domeniu convex și compact inclus în $[a, b]^n$, restricția lui $E(x_1, \dots, x_n)$ la Ω își atinge maximul într-un punct din frontiera lui Ω .

Demonstrația Teoremei 2 se bazează pe o binecunoscută rafinare a Teoremei lui Lagrange, a creșterilor finite:

Lema 2 (Generalizarea Teoremei lui Lagrange). *Fie $h : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ o funcție continuă, care admite derivată la dreapta finită în orice punct din $[a, b]$. Atunci există două puncte α și β în $[a, b)$ astfel încât*

$$h'_d(\alpha) \leq \frac{h(b) - h(a)}{b - a} \leq h'_d(\beta).$$

Demonstrație. Ca și în cazul "diferențiabil", considerăm funcția auxiliară

$$H(x) = h(x) - \frac{h(b) - h(a)}{b - a}(x - a), \quad x \in [a, b].$$

Evident, funcția H este continuă și $H(a) = H(b)$. Alegem $\bar{\alpha}$ și $\bar{\beta}$ în $[a, b]$ astfel încât

$$H(\bar{\alpha}) = \inf H \quad \text{și} \quad H(\bar{\beta}) = \sup H.$$

Dacă $H(\bar{\alpha}) = H(\bar{\beta})$, atunci H este constantă și putem alege $\alpha = \beta$ arbitrar în $[a, b]$.

Dacă $H(\bar{\alpha}) < H(\bar{\beta})$, atunci $\bar{\alpha} \neq \bar{\beta}$ și putem presupune că $\bar{\alpha}, \bar{\beta} \in [a, b]$; vezi faptul că $H(a) = H(b)$.

Considerăm cazul când $a \leq \bar{\alpha} < \bar{\beta} < b$. Din faptul că $\bar{\alpha}$ este un punct de minim și $\bar{\beta}$ este un punct de maxim, rezultă că

$$\begin{aligned} H'_d(\bar{\alpha}) &= \lim_{x \rightarrow \bar{\alpha}+0} \frac{H(x) - H(\bar{\alpha})}{x - \bar{\alpha}} \geq 0 \\ H'_d(\bar{\beta}) &= \lim_{x \rightarrow \bar{\beta}+0} \frac{H(x) - H(\bar{\beta})}{x - \bar{\beta}} \leq 0. \end{aligned}$$

Or,

$$H'_d(\bar{\alpha}) = h'_d(\bar{\alpha}) - \frac{h(b) - h(a)}{b - a}$$

și

$$H'_d(\bar{\beta}) = h'_d(\bar{\beta}) - \frac{h(b) - h(a)}{b - a}.$$

Rezultă că proprietatea din enunț este verificată pentru $\alpha = \bar{\beta}$ și $\beta = \bar{\alpha}$.

Cazul când $a \leq \bar{\beta} < \bar{\alpha} < b$ se tratează similar. ■

Demonstrația Teoremei 2. Vom demonstra că pentru orice $x_k \in [m_k, M_k]$, $k \in \{1, \dots, n\}$, avem

$$E(x_1, \dots, x_k, \dots, x_n) \leq \sup \{E(x_1, \dots, m_k, \dots, x_n), E(x_1, \dots, M_k, \dots, x_n)\}.$$

Raționând prin reducere la absurd, este suficient să considerăm cazul când $k = 1$ și când avem

$$E(x_1, x_2, \dots, x_n) > \sup \{E(m_1, x_2, \dots, x_n), E(M_1, x_2, \dots, x_n)\}.$$

Fixând $x_k \in [m_k, M_k]$ pentru $k \in \{2, \dots, n\}$, considerăm funcția

$$h : [m_1, M_1] \rightarrow \mathbb{R}, \quad h(x) = E(x, x_2, \dots, x_n).$$

Conform Lemei 2, există $\xi \in [m_1, x_1]$ încât $h(x_1) - h(m_1) \leq (x_1 - m_1)h'_d(\xi)$. Deoarece $h(x_1) > h(m_1)$, rezultă că $h'_d(\xi) > 0$, echivalent,

$$f'_d(\xi) > f'_d(\alpha_1\xi + \alpha_2x_2 + \dots + \alpha_nx_n).$$

Întrucât f'_d este o funcție crescătoare, acest fapt conduce la $\xi > \alpha_1\xi + \alpha_2x_2 + \dots + \alpha_nx_n$, adică la

$$\xi > \frac{\alpha_2x_2 + \dots + \alpha_nx_n}{\alpha_2 + \dots + \alpha_n}.$$

Aplicând din nou Lema 2 funcției h dar pe intervalul $[x_1, M_1]$, deducem existența unui $\eta \in [x_1, M_1]$ încât

$$\eta < \frac{\alpha_2x_2 + \dots + \alpha_nx_n}{\alpha_2 + \dots + \alpha_n}.$$

Apare astfel o contradicție privind poziționarea lui ξ și η , ceea ce încheie demonstrația. ■

3. ANALOGUL CONTINUU AL TEOREMEI 1 ȘI GENERALIZAREA INEGALITĂȚII LUI CEBÂȘEV

Varianta continuă a Teoremei 1 rezultă din aceasta prin tehnica sumelor integrale. Locul combinațiilor convexe îl ia *media*, care în cazul unei funcții integrabile (Riemann) $g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ este numărul

$$M(g) = \frac{1}{b-a} \int_a^b g(x) dx.$$

Media se poate defini de asemenea ca o limită de combinații convexe,

$$M(g) = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} \sum_{k=0}^{n-1} g\left(a + k \cdot \frac{b-a}{n}\right).$$

Lema 3. *Dacă imaginea lui g este inclusă într-un interval I , atunci media sa aparține de asemenea lui I .*

Demonstrație. Dacă I este un interval închis, atunci utilizăm faptul ca acesta conține odată cu un șir convergent și limita sa. În celălalt caz, dacă de exemplu $g < M$, atunci avem de arătat că $M(g) < M$, adică

$$\int_a^b (M - g) dx > 0.$$

Or această ultimă relație este adevărată întrucât integrala unei funcții strict pozitive este un număr strict pozitiv; vezi [3], pagina 106, punctul 304. ■

Cu observațiile de mai sus, varianta continuă a Teoremei 1 este următoarea:

Teorema 3. *Fie $g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ o funcție integrabilă și fie f o funcție convexă definită pe un interval I , care include imaginea lui g . Presupunem că funcția $f \circ g$ este integrabilă. Atunci oricare ar fi $\varphi \in \partial f$ cu proprietatea că $\varphi \circ g$ este integrabilă, are loc inegalitatea*

$$0 \leq M(f \circ g) - f(M(g)) \leq M(g \cdot (\varphi \circ g)) - M(g)M(\varphi \circ g).$$

Ipoteza că $f \circ g$ și $\varphi \circ g$ sunt funcții integrabile apare motivată tehnic prin apariția mediilor. Ea nu se poate realiza ca efect al celorlalte ipoteze. Considerăm de exemplu cazul funcțiilor

$$f(x) = \begin{cases} 0, & \text{dacă } x \leq 0 \\ x, & \text{dacă } x \geq 0, \end{cases}$$

convexă pe \mathbb{R} și

$$g(x) = \begin{cases} 1/q, & \text{dacă } x = \frac{p}{q} \in [0, 1], \text{ cu } p, q \in \mathbb{N}^*, (p, q) = 1 \\ 0, & \text{în restul intervalului } [0, 1], \end{cases}$$

integrabilă pe intervalul $[0, 1]$. Funcția

$$\varphi(x) = \begin{cases} 0, & \text{dacă } x \leq 0 \\ 1, & \text{dacă } x > 0. \end{cases}$$

aparține lui ∂f și $\varphi \circ g = \chi_{\mathbb{Q} \cap [0, 1]}$ este funcția lui Dirichlet, despre care se știe că *nu* este integrabilă Riemann pe intervalul $[0, 1]$.

Este important să observăm că Teorema 3 poate fi reformulată de o manieră mult mai puternică, pornind de la faptul că orice funcție crescătoare aparține subdiferențialei unei funcții convexe. Într-adevăr, dacă $\varphi : I \rightarrow \mathbb{R}$ este o funcție crescătoare și $a \in I$, atunci funcția

$$\Phi(x) = \int_a^x \varphi(t) dt$$

este convexă (și $\Phi'(x) = \varphi(x)$ în toate punctele de continuitate ale lui φ). Să numim *primitivă* a lui φ orice funcție continuă $\Psi : I \rightarrow \mathbb{R}$ care verifică egalitatea $\Psi'(x) = \varphi(x)$ în toate punctele de continuitate ale lui φ . Se poate arăta că orice două primitive ale lui φ diferă printr-o constantă. Vezi [5], Corolarul 6.5.3.

Discuția de mai sus ne permite să deducem din Teorema 3 următorul rezultat, care extinde inegalitatea lui Cebâșev:

Teorema 4. *Fie $g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ o funcție integrabilă și fie φ o funcție crescătoare definită pe un interval I , care include imaginea lui g și astfel că $\varphi \circ g$ este integrabilă*

pe $[a, b]$. Atunci oricare ar fi Φ o primitivă a lui φ cu proprietatea că $\Phi \circ g$ este integrabilă are loc inegalitatea

$$M(g \cdot (\varphi \circ g)) - M(g)M(\varphi \circ g) \geq M(\Phi \circ g) - \Phi(M(g)) \geq 0.$$

Corolar (Inegalitatea lui Cebâșev). Fie $g, h : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ două funcții crescătoare. Are loc inegalitatea

$$M(g \cdot h) - M(g)M(h) \geq 0.$$

Demonstrație. Felul cum inegalitatea lui Cebâșev rezultă din Teorema 4 este clar atunci când g este strict crescătoare; se ia $\varphi = h \circ g^{-1}$. În cazul general, se înlocuiește g cu o perturbație strict crescătoare a sa, de exemplu $g + \varepsilon x$. Rezultă

$$M((g + \varepsilon x) \cdot h) - M(g + \varepsilon x)M(h) \geq 0$$

potrivit cazului deja analizat și se trece apoi la limită după $\varepsilon \rightarrow 0$. ■

Teorema 2 are și ea un analog continuu, a cărui formulare o lăsăm cititorului ca exercițiu.

4. APLICAȚII

i) Să considerăm cazul funcției $f(x) = |x|$, $x \in \mathbb{R}$. Funcția f este convexă și $\varphi = \text{sgn} \in \partial f$.

Conform Teoremei 1, pentru orice $x_1, \dots, x_n \in [-M, M]$ avem

$$\frac{1}{n} \sum_{k=1}^n |x_k| - \left| \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n x_k \right| \leq \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n |x_k| - \left(\frac{1}{n} \sum_{k=1}^n x_k \right) \left(\frac{1}{n} \sum_{k=1}^n \text{sgn } x_k \right)$$

adică

$$\left(\frac{1}{n} \sum_{k=1}^n x_k \right) \left(\frac{1}{n} \sum_{k=1}^n \text{sgn } x_k \right) \leq \left| \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n x_k \right|$$

formal mai tare decât ceea ce ne oferă inegalitatea lui Cebâșev.

În același timp, Teorema 2 afirmă existența unui $j \in \{1, \dots, n\}$ astfel încât

$$\frac{1}{n} \sum_{k=1}^n |x_k| - \left| \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n x_k \right| \leq M - \left| \frac{n-j}{n} M - \frac{j}{n} M \right|$$

ceea ce conduce la

$$\begin{aligned} \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n |x_k| - \left| \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n x_k \right| &\leq M \left(n - \inf_{j \in \{1, \dots, n\}} |n - 2j| \right) = \\ &= \begin{cases} Mn, & \text{dacă } n \text{ este par} \\ M(n-1), & \text{dacă } n \text{ este impar.} \end{cases} \end{aligned}$$

ii) Fie $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ o funcție convexă și continuă. Conform Teoremei 2, are loc relația

$$\frac{f(a) + f(b)}{2} - f\left(\frac{a+b}{2}\right) = \sup_{x,y \in [a,b]} \left[\frac{f(x) + f(y)}{2} - f\left(\frac{x+y}{2}\right) \right].$$

În particular,

$$\frac{f(a) + f(b)}{2} - f\left(\frac{a+b}{2}\right) \geq \frac{f(c) + f(d)}{2} - f\left(\frac{c+d}{2}\right)$$

pentru orice $a \leq c \leq d \leq b$.

Această observație poate fi sursa unor inegalități interesante ca de exemplu:

$$\frac{a^n + b^n}{2} - \left(\frac{a+b}{2}\right)^n \geq \frac{c^n + d^n}{2} - \left(\frac{c+d}{2}\right)^n$$

pentru orice $0 \leq a \leq c \leq d \leq b$ și orice $n \geq 1$.

iii) Vom aplica la acest punct Teorema 2 pentru a regăsi un rezultat al lui L. G. Khanin [4]: Fie $p > 1$, $x_1, \dots, x_n \in [0, M]$ și fie $\alpha_1, \dots, \alpha_n \in [0, 1]$, cu $\sum_{k=1}^n \alpha_k = 1$. Atunci

$$\sum_{k=1}^n \alpha_k x_k^p \leq \left(\sum_{k=1}^n \alpha_k x_k\right)^p + (p-1)p^{p/(1-p)}M^p.$$

În particular,

$$\frac{x_1^2 + \dots + x_n^2}{n} \leq \frac{(x_1 + \dots + x_n)^2}{n} + \frac{M^2}{4},$$

fapt care poate fi privit ca o inegalitate de tip Cauchy-Schwarz inversă.

Într-adevăr, potrivit Teoremei 2, funcția

$$E(x_1, \dots, x_n) = \sum_{k=1}^n \alpha_k x_k^p - \left(\sum_{k=1}^n \alpha_k x_k\right)^p,$$

definită pentru $x_1, \dots, x_n \in [0, M]$, își atinge maximul când o parte din variabile sunt 0 și celelalte sunt M . Prin urmare,

$$\begin{aligned} \sup E(x_1, \dots, x_n) &\leq M^p \cdot \sup \{s - s^p; s \in [0, 1]\} = \\ &= (p-1)p^{p/(1-p)}M^p. \end{aligned}$$

iv) Teorema 4 conduce la inegalități foarte interesante. O mostră ne oferă perechea de funcții

$$\varphi(x) = x + \cos x, \text{ care este crescătoare pe } \mathbb{R}$$

și

$$g(x) = \sin \frac{1}{x}, \text{ care are monotonie oscilantă pe } [0, 1].$$

Se obține:

$$\int_0^1 \left(\sin \frac{1}{x} \right) \left(\sin \frac{1}{x} + \cos \sin \frac{1}{x} \right) dx \geq \left(\int_0^1 \sin \frac{1}{x} dx \right) \left(\int_0^1 \left(\sin \frac{1}{x} + \cos \sin \frac{1}{x} \right) dx \right).$$

Programul MAPLE V5, ne arată că diferența dintre cei doi membri este 0.37673... Este demn de notat că integralele care intervin în inegalitatea de mai sus nu sunt exprimabile cu ajutorul funcțiilor elementare.

REFERENCES

- [1] Cârtoaje Vasile, *Asupra unor inegalități cu restricții*, Revista de matematică din Timișoara, **1** (1990), 3-7.
- [2] Drimbe Mihai Onucu, *O legătură dintre inegalitățile Jensen și Cebășev*, Gazeta Matematică, **CI** (1996), nr. 5-6, pp. 270-273.
- [3] Fihtenholt G. M., *Curs de calcul diferențial și integral*, vol. II, Editura Tehnică, București, 1964.
- [4] Khanin L. G., Problema M 1083, Kvant, **18** (1988), nr. 1, p. 35 și Kvant **18** (1988), nr. 5, p. 35.
- [5] Niculescu P. Constantin, *Fundamentele analizei matematice. Analiza pe dreapta reală*. Editura Academiei, București, 1996.
- [6] Niculescu P. Constantin, *An extension of Chebyshev's Inequality and its Connection with Jensen's Inequality*, Journal of Inequalities and Applications, Volume **6** (2001), nr. 4, pp. 451-462.
- [7] Pop Iulia, *O caracterizare a funcțiilor convexe*, Gazeta Matematică, **IC** (1994), nr. 7, pp. 313-314.