

## Mathematik für Anwender I

### Vorlesung 27

#### Uneigentliche Integrale

BEISPIEL 27.1. Wir knüpfen an Beispiel 24.9 an, d.h., es liegen zwei Massen  $M$  und  $m$  vor, die untereinander den Abstand  $R_0$  besitzen. Wieviel Energie muss man aufwenden, um die beiden Massen unendlich weit voneinander zu entfernen? In Beispiel 24.9 haben wir die Energie berechnet, um den Abstand von  $R_0$  auf  $R_1$  zu erhöhen, nämlich

$$E(R_1) = \int_{R_0}^{R_1} \gamma \frac{Mm}{r^2} dr = \gamma Mm \left( \frac{1}{R_0} - \frac{1}{R_1} \right).$$

Für  $R_1 \rightarrow \infty$  ist  $\frac{1}{R_1} \rightarrow 0$  und daher ist  $E(R_1) \rightarrow \gamma Mm \frac{1}{R_0}$ .

Dieses Beispiel zeigt, dass es sinnvoll sein kann, bei bestimmten Integralen die Intervallgrenzen „gegen unendlich laufen zu lassen“. Dies führt zum Begriff der *uneigentlichen Integrale*.

Unter einem Randpunkt eines (ein- oder beidseitig) unbeschränkten Intervalls verstehen wir im Folgenden auch die Symbole  $\infty$  und  $-\infty$ . Dies heißt nicht, dass diese Symbole zu  $\mathbb{R}$  gehören, sondern lediglich, dass man dafür sinnvolle Grenzwertbetrachtungen durchführen kann. Die Definition für den Grenzwert einer Funktion gegen  $+\infty$  bzw.  $-\infty$  lautet folgendermaßen.

DEFINITION 27.2. Es sei  $T = [a, \infty)$  (oder  $T = [\infty, a]$ ) ein rechtsseitig (bzw. linksseitig) unbeschränktes Intervall und

$$f : T \longrightarrow \mathbb{R}$$

eine Funktion. Dann heißt  $b \in \mathbb{R}$  *Grenzwert* (oder *Limes*) von  $f$  für  $x \rightarrow +\infty$  (bzw.  $x \rightarrow -\infty$ ), wenn es für jedes  $\epsilon > 0$  ein  $x_0 \geq a$  (bzw.  $x_0 \leq a$ ) gibt mit  $|f(x) - b| \leq \epsilon$  für alle  $x \geq x_0$  (bzw.  $x \leq x_0$ ). In diesem Fall schreibt man

$$\lim_{x \rightarrow +\infty} f(x) = b$$

(bzw.  $\lim_{x \rightarrow -\infty} f(x) = b$ ).

Die Rechenregeln für diesen Grenzwertbegriff sind weitgehend analog zu den Rechenregeln für den bisherigen Grenzwertbegriff für Funktionen (siehe Lemma 15.10). Sie sind auch analog zu den Rechenregeln für Limiten von Folgen (siehe Lemma 12.10).

DEFINITION 27.3. Es sei  $I \subseteq \mathbb{R}$  ein Intervall,  $r$  ein Randpunkt von  $I$  und  $a \in I$ . Es sei eine stetige Funktion

$$f : I \longrightarrow \mathbb{R}$$

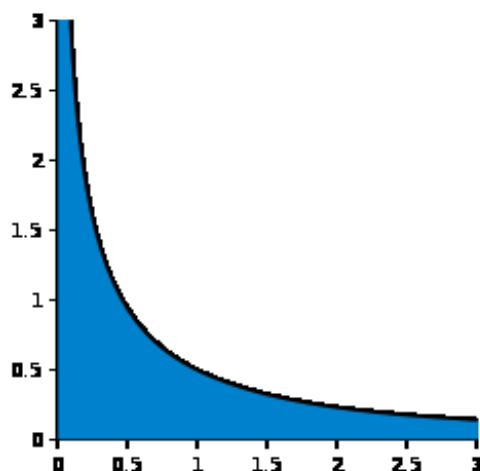
gegeben. Man sagt, dass das *uneigentliche Integral* zu  $f$  für  $x \rightarrow r$  existiert, wenn der Grenzwert

$$\lim_{x \rightarrow r} \int_a^x f(t) dt$$

existiert. In diesem Fall schreibt man für diesen Grenzwert auch

$$\int_a^r f(t) dt$$

und nennt dies das *uneigentliche Integral* von  $a$  nach  $r$



Die Funktion  $\frac{1}{(x+1)\sqrt{x}}$ , der blaue Flächeninhalt repräsentiert das (beidseitig) uneigentliche Integral.

Die Existenz dieses uneigentlichen Integrals hängt nicht von dem gewählten Intervallpunkt  $a \in I$  ab, wohl aber der Wert des uneigentlichen Integrals. Die inhaltliche Interpretation des uneigentlichen Integrals ist wiederum der Flächeninhalt unterhalb des Funktionsgraphen, aber erstreckt über ein nicht notwendigerweise kompaktes Intervall. Wenn für die Funktion  $f$  eine Stammfunktion  $F$  bekannt ist, so geht es um das Bestimmen des Grenzwertes

$$\lim_{x \rightarrow r} \int_a^x f(t) dt = \lim_{x \rightarrow r} F(x) - F(a).$$

LEMMA 27.4. Es sei  $I$  ein reelles Intervall,  $a \in I$  und  $r$  sei ein Randpunkt von  $I$ . Es seien

$$f, h : I \longrightarrow \mathbb{R}_{\geq 0}$$

stetige Funktionen mit

$$f(t) \leq h(t) \text{ für alle } t \in I$$

und es sei vorausgesetzt, dass das uneigentliche Integral

$$\int_a^r h(t) dt$$

existiert. Dann existiert auch das uneigentliche Integral

$$\int_a^r f(t) dt$$

und es gilt

$$\int_a^r f(t) dt \leq \int_a^r h(t) dt$$

*Beweis.* Wir behandeln den Fall, wo  $r$  die obere Intervallgrenze ist. Für alle  $b \in I$  ist

$$\int_a^b f(t) dt \leq \int_a^b h(t) dt$$

wegen  $f(t) \leq h(t)$  für alle  $t \in I$ . Wegen der Nichtnegativität von  $h$  und von  $f$  wachsen beide Seite bei  $b \rightarrow r$ , und die rechte Seite ist durch das uneigentliche Integral  $\int_a^r h(t) dt$  beschränkt. Nach Satz 13.10 existiert der Grenzwert

$$\lim_{b \rightarrow r} \int_a^b f(t) dt = \int_a^r f(t) dt.$$

□

BEISPIEL 27.5. Sei  $f(t) := t^c$  mit  $c \in \mathbb{R}$ . Wir interessieren uns für die uneigentlichen Integrale zu  $f$  für  $t$  von 0 bis 1. Dabei ist die Funktion bei der Intervallgrenze 0 (bei negativem  $c$ ) nicht definiert, das ist also der kritische Randpunkt. Bei  $c = -1$  ist  $\ln t$  eine Stammfunktion von  $1/t$ . Daher ist

$$\int_x^1 \frac{1}{t} dt = -\ln x,$$

und der Grenzwert für  $x \rightarrow 0$  existiert nicht. Das uneigentliche Integral existiert also nicht.

Sei nun  $c < -1$ . Dann ist  $\frac{1}{c+1}t^{c+1}$  eine Stammfunktion zu  $t^c$  und daher ist

$$\lim_{x \rightarrow 0} \left( \int_x^1 t^c dt \right) = \lim_{x \rightarrow 0} \left( \frac{1}{c+1} t^{c+1} \Big|_x^1 \right) = \lim_{x \rightarrow 0} \left( \frac{1}{c+1} - \frac{x^{c+1}}{c+1} \right).$$

Da es sich rechts um eine negative Potenz von  $x$  handelt, ist  $\lim_{x \rightarrow 0} x^{c+1} = \infty$ . Das uneigentliche Integral existiert also nicht. Dies folgt übrigens auch aus Lemma 27.4, da ja  $t^{-1} \leq t^c$  für  $c < -1$  und  $0 < t \leq 1$  gilt.

Sei nun  $c > -1$ . Dann ist  $\frac{1}{c+1}t^{c+1}$  eine Stammfunktion zu  $t^c$  und daher ist

$$\lim_{x \rightarrow 0} \left( \int_x^1 t^c dt \right) = \lim_{x \rightarrow 0} \left( \frac{1}{c+1} t^{c+1} \Big|_x^1 \right) = \lim_{x \rightarrow 0} \left( \frac{1}{c+1} - \frac{x^{c+1}}{c+1} \right).$$

Da es sich um eine positive Potenz von  $x$  handelt, ist  $\lim_{x \rightarrow 0} x^{c+1} = 0$  (nach Aufgabe 17.10). Das uneigentliche Integral existiert also und besitzt den Wert  $\frac{1}{c+1}$ .

BEISPIEL 27.6. Sei  $f(t) := t^c$  mit  $c \in \mathbb{R}$ . Wir interessieren uns für das uneigentliche Integral zu  $f$  für  $t$  von 1 bis  $\infty$ . Der kritische Randpunkt ist also  $+\infty$ . Bei  $c = -1$  ist  $\ln t$  eine Stammfunktion von  $1/t$ . Daher ist

$$\int_1^x \frac{1}{t} dt = \ln x,$$

und der Grenzwert für  $x \rightarrow +\infty$  existiert nicht. Das uneigentliche Integral existiert also nicht.

Sei nun  $c < -1$ . Dann ist  $\frac{1}{c+1}t^{c+1}$  eine Stammfunktion zu  $t^c$  und daher ist

$$\lim_{x \rightarrow \infty} \left( \int_1^x t^c dt \right) = \lim_{x \rightarrow \infty} \left( \frac{1}{c+1} t^{c+1} \Big|_1^x \right) = \lim_{x \rightarrow \infty} \left( \frac{x^{c+1}}{c+1} - \frac{1}{c+1} \right).$$

Da es sich um eine negative Potenz von  $x$  handelt, ist  $\lim_{x \rightarrow \infty} x^{c+1} = 0$ . Das uneigentliche Integral existiert also und besitzt den Wert  $-\frac{1}{c+1}$ .

Bei  $c > -1$  ist  $t^c \geq t^{-1}$  für  $t \geq 1$  und daher kann nach Lemma 27.4 das uneigentliche Integral nicht existieren.

DEFINITION 27.7. Es sei  $I \subseteq \mathbb{R}$  ein Intervall mit den beiden Randpunkten  $r$  und  $s$  von  $I$ . Es sei eine stetige Funktion

$$f : I \longrightarrow \mathbb{R}$$

gegeben. Man sagt, dass das (*beidseitig*) *uneigentliche Integral*

$$\int_r^s f(t) dt$$

existiert, wenn für ein  $a \in I$  die beiden einseitig uneigentlichen Integrale

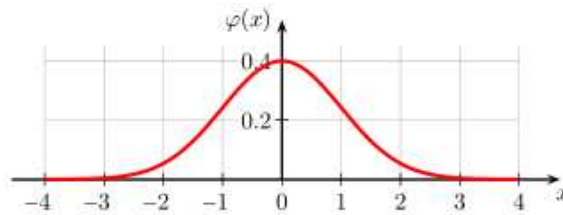
$$\int_r^a f(t) dt \text{ und } \int_a^s f(t) dt$$

existieren. In diesem Fall setzt man

$$\int_r^s f(t) dt := \int_r^a f(t) dt + \int_a^s f(t) dt$$

und nennt dies das *uneigentliche Integral* zu  $f$  von  $r$  nach  $s$ .

Die Existenz des beidseitig uneigentlichen Integrals hängt nicht von der Wahl des Punktes  $a \in I$  ab. Darüberhinaus hängt der Wert dieses Integrals, falls es existiert, ebensowenig von dem gewählten Punkt ab.



Die Funktion  $\frac{1}{\sqrt{2\pi}}e^{-\frac{t^2}{2}}$  ist die Dichtefunktion der Gaußschen Normalverteilung. Der Flächeninhalt unterhalb der Kurve ist 1.

BEISPIEL 27.8. Die Funktion  $e^{-t^2}$  ist nicht elementar integrierbar, d.h., man kann keine geschlossene Stammfunktion mit rationalen Funktionen, Exponentialfunktion, trigonometrischen Funktionen und ihren Umkehrfunktionen angeben. Es ist

$$\int_{-\infty}^{\infty} e^{-t^2} dt = \sqrt{\pi},$$

was wir hier ohne Beweis mitteilen. Durch eine einfache Substitution ergibt sich daraus

$$\frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^{\infty} e^{-\frac{t^2}{2}} dt = 1.$$

Dieses Integral nennt man *Fehlerintegral*; es spielt in der Stochastik eine wichtige Rolle.

### Vergleichskriterien mit Reihen

LEMMA 27.9. Sei  $I = [1, \infty]$  ein rechtsseitig unbeschränktes Intervall und sei

$$f : I \longrightarrow \mathbb{R}$$

eine stetige fallende Funktion mit  $f(x) \geq 0$  für alle  $x \in I$ . Dann existiert das uneigentliche Integral

$$\int_1^{\infty} f(t) dt$$

genau dann, wenn die Reihe

$$\sum_{n=1}^{\infty} f(n)$$

konvergiert.

*Beweis.* Wenn das uneigentliche Integral existiert, so betrachten wir die Abschätzung

$$\sum_{n=2}^k f(n) \leq \int_1^k f(t) dt,$$

die darauf beruht, dass die linke Seite das Treppenintegral zu einer unteren Treppenfunktion für  $f$  auf  $[1, k]$  ist. Da die rechte Seite beschränkt ist, gilt

dies auch für die linke Seite, so dass wegen  $f(n) \geq 0$  die Reihe konvergiert. Ist umgekehrt die Reihe konvergent, so betrachten wir die Abschätzung

$$\int_1^k f(t) dt \leq \sum_{n=1}^{k-1} f(n),$$

die gilt, da die rechte Seite das Treppenintegral zu einer oberen Treppenfunktion ist. Wegen  $f(t) \geq 0$  ist die Integralfunktion  $x \mapsto \int_1^x f(t) dt$  wachsend und beschränkt, da die rechte Seite wegen der Konvergenz der Reihe beschränkt ist. Daher besitzt die Integralfunktion für  $x \mapsto \infty$  einen Grenzwert und das uneigentliche Integral existiert.  $\square$

BEISPIEL 27.10. Die Funktion

$$f : [1, \infty] \longrightarrow \mathbb{R}, t \longmapsto \frac{1}{t},$$

ist streng fallend. Daher ist die Funktion  $g$ , die für  $x$  mit  $k \leq x < k+1$  durch  $\frac{1}{k}$  definiert ist, eine Majorante für  $f$ , also  $g(t) \geq f(t)$ . Auf jedem Intervall  $[1, n]$  liefert  $g$  eine obere Treppenfunktion zu  $f$ . Ebenso liefert die durch  $\frac{1}{k+1}$  bei  $k \leq x < k+1$  definierte Funktion  $h$  eine untere Treppenfunktion für  $f$ . Daher gelten die Abschätzungen

$$\sum_{k=1}^{n-1} \frac{1}{k} \geq \int_1^n \frac{1}{t} dt \geq \sum_{k=1}^{n-1} \frac{1}{k+1}.$$

Das Integral in der Mitte besitzt den Wert  $\ln n$ . Die Differenz zwischen der linken und der rechten Summe ist  $1 - \frac{1}{n}$ . Daher ist die Differenz

$$\sum_{k=1}^{n-1} \frac{1}{k} - \ln n$$

für jedes  $n$  positiv, mit  $n$  wachsend und nach oben beschränkt. Daher existiert für  $n \rightarrow \infty$  der Limes, und dieser Limes ändert sich nicht, wenn man vorne in der Summe bis  $n$  aufsummiert anstatt bis  $n-1$ . Wir setzen

$$\gamma := \lim_{n \rightarrow \infty} \left( \sum_{k=1}^n \frac{1}{k} - \ln n \right)$$

und nennen sie die *eulersche Konstante* (oder *Mascheronische Konstante*). Ihr numerischer Wert ist ungefähr

$$\gamma = 0,5772156649\dots$$

Es ist ein offenes mathematisches Problem, ob diese Zahl rational ist oder nicht.

## Abbildungsverzeichnis

Quelle = Improper integral.svg , Autor = Benutzer KSmrq auf Commons, Lizenz = CC-by-sa 3.0	2
Quelle = Normal distribution.svg , Autor = Benutzer Geek3 auf Commons, Lizenz = CC-by-sa 3.0	5