

# Математический анализ

Харитонцев-Беглов Сергей

28 марта 2022 г.

## Содержание

<b>1. Интегральное исчисление функции одной переменной</b>	<b>1</b>
1.1 Первообразная и неопределенный интеграл . . . . .	1
1.2 Определенный интеграл . . . . .	3
1.3 Свойства интеграла . . . . .	5
1.4 Приложения формулы интегрирования по частям . . . . .	9
<b>Отступление. Равномерная непрерывность</b>	<b>12</b>
<b>Продолжение главы 1</b>	<b>14</b>
1.5 Интегральные суммы . . . . .	14
1.6 Несобственные интегралы . . . . .	18
<b>2. Анализ в метрических пространствах</b>	<b>25</b>
2.1 Метрические и нормированные пространства . . . . .	25
2.2 Компактность . . . . .	33
2.3 Непрерывные отображения . . . . .	37
2.4 Длина кривой . . . . .	40
2.5 Линейные операторы . . . . .	43
<b>3. Ряды</b>	<b>46</b>
3.1 Ряды в нормированных пространствах . . . . .	46
3.2 Знакопостоянные ряды . . . . .	47

# 1. Интегральное исчисление функции одной переменной

## 1.1. Первообразная и неопределенный интеграл

**Определение 1.1.**  $f: \langle a, b \rangle \rightarrow \mathbb{R}$ . Функция  $F: \langle a, b \rangle \rightarrow \mathbb{R}$  — первообразная функции  $f$ , если  $F'(x) = f(x) \forall x \in \langle a, b \rangle$

**Теорема 1.1.** Непрерывная на промежутке функция имеет первообразную.

**Доказательство.** Позже. □

**Замечание.**  $\text{sign } x = \begin{cases} 1 & \text{если } x > 0 \\ 0 & \text{если } x = 0. \text{ Не имеет первообразной.} \\ -1 & \text{если } x < 0 \end{cases}$

**Доказательство.** От противного: пусть нашлась  $F: \langle a, b \rangle \rightarrow \mathbb{R}$  и  $F'(x) = \text{sign}(x)$ .

Тогда воспользуемся теоремой Дарбу для  $F$  на отрезке  $[0; 1]$ .

Пусть  $k = \frac{1}{2} \in (\text{sign}(0), \text{sign}(1))$ . Значит  $\exists c \in (0, 1): F'(c) = k = \frac{1}{2}$ . Противоречие. □

**Теорема 1.2.**  $f, F: \langle a, b \rangle \rightarrow \mathbb{R}$  и  $F$  — первообразная для  $f$ . Тогда:

1.  $F + C$  — первообразная для  $f$ .
2. Если  $\Phi: \langle a, b \rangle \rightarrow \mathbb{R}$  — первообразная для  $f$ , то  $\Phi = F + C$ .

**Доказательство.**

1.  $(F(x) + C)' = F'(x) + C' = f(x)$
2.  $(\Phi(x) - F(x))' = \Phi'(x) - F'(x) = f(x) - f(x) = 0 \Rightarrow (\Phi - F)' \equiv 0 \Rightarrow \Phi - F$  — константа. □

**Определение 1.2.** Неопределённый интеграл — множество всех первообразных.

$\int f(x) dx = \{F: F \text{ — первообразная } f\}$ . Но мы будем записывать  $\int f(x) dx = F(x) + C$

**Табличка интегралов.**

1.  $\int 0 dx = C$ .
2.  $\int x^p dx = \frac{x^{p+1}}{p+1} + C$ , при  $p \neq -1$ .
3.  $\int \frac{dx}{x} = \ln |x| + C$ .
4.  $\int a^x dx = \frac{a^x}{\ln a} + c$ , при  $a > 0, a \neq 1$ .
5.  $\int \sin x dx = -\cos x + C$ .
6.  $\int \cos x dx = \sin x + C$ .

7.  $\int \frac{dx}{\cos^2 x} = \operatorname{tg} x + C.$
8.  $\int \frac{dx}{\sin^2 x} = -\operatorname{ctg} x + C$
9.  $\int \frac{dx}{\sqrt{1-x^2}} = \arcsin x + C.$
10.  $\int \frac{dx}{1+x^2} = \operatorname{arctg} x + C.$
11.  $\int \frac{dx}{\sqrt{x^2 \pm 1}} = \ln |x + \sqrt{x^2 \pm 1}| + C.$
12.  $\int \frac{dx}{1-x^2} = \frac{1}{2} \ln \left| \frac{1+x}{1-x} \right| + C.$

**Доказательство.** Для 3. Если  $x > 0$   $\int \frac{dx}{x} = \ln x + C$ . Если  $x < 0$   $\int \frac{dx}{x} = \ln(-x) + C$ , то есть  $(\ln(-x))' = (\frac{1}{-x})(-x)' = \frac{-1}{x}$ .

$$\text{Для 11. } (\ln |x + \sqrt{x^2 \pm 1}|)' = \frac{1}{x + \sqrt{x^2 \pm 1}} (x + \sqrt{x^2 \pm 1})' = \frac{1 + \frac{x}{\sqrt{x^2 \pm 1}}}{x + \sqrt{x^2}} = \frac{\frac{\sqrt{x^2 \pm 1} + x}{\sqrt{x^2 \pm 1}}}{x + \sqrt{x^2 \pm 1}} = \frac{1}{\sqrt{x^2 \pm 1}}$$

$$\text{Для 13. } (\frac{1}{2}(\ln |1+x| - \ln |1-x|))' = \frac{1}{2}(\frac{1}{1+x} + \frac{1}{1-x}) = \frac{1}{1-x^2}$$

□

**Замечание.**  $A + B := \{a + b : a \in A, b \in B\}$ ,  $cA := \{ca : a \in A\}$ .

$$\int f(x) dx + \int g(x) dx = \{F + C\} + \{G + \tilde{C}\} = \{F + G + C\}.$$

**Теорема 1.3** (Арифметические действия с неопределенными интегралами). Пусть  $f, g : \langle a, b \rangle \rightarrow \mathbb{R}$  имеют первообразные. Тогда:

1.  $f + g$  имеет первообразную и  $\int (f + g) dx = \int f dx + \int g dx$
2.  $\alpha f$  имеет первообразную и  $\int \alpha f dx = \alpha \int f dx$

**Доказательство.** Пусть  $F$  и  $G$  первообразные для  $f$  и  $g$ .

1. Тогда  $F + G$  — первообразная для  $f + g$ . Тогда  $\int (f + g) = F + G + C = \int f + \int g$ .
2. Тогда  $\alpha F$  — первообразная для  $\alpha f \implies \int \alpha f = \alpha F + C = \alpha(F + \frac{C}{\alpha}) = \alpha \int f$ .

□

**Следствие Линейность неопределенного интеграла.**  $f, g : \langle a, b \rangle \rightarrow \mathbb{R}$  имеют первообразную  $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$ ,  $|\alpha| + |\beta| \neq 0$ . Тогда  $\int (\alpha f + \beta g) = \alpha \int f + \beta \int g$ .

**Доказательство.** Прямое следствие из теоремы выше.

□

**Теорема 1.4** (Теорема о замене переменной в неопределенном интеграле).  $f : \langle a, b \rangle \rightarrow \mathbb{R}$ ,  $\varphi : \langle c, d \rangle \rightarrow \langle a, b \rangle$ ,  $f$  имеет первообразную  $F$ .  $\varphi$  дифференцируемая. Тогда  $\int f(\varphi(t))\varphi'(t) dt = F(\varphi(t)) + C$ .

**Доказательство.** Надо проверить, что  $F(\varphi(t))$  — первообразная для  $f(\varphi(t))\varphi'(t)$ .

$$(F(\varphi(t)))' = F'(\varphi(t)) \cdot \varphi'(t) = f(\varphi(t))\varphi'(t).$$

□

**Следствие.**  $\int f(\alpha x + \beta) dx = \frac{1}{\alpha} F(\alpha x + \beta) + C$

**Доказательство.**  $\int \alpha f(\alpha x + \beta) dx = F(\alpha x + \beta) + C$ . И делим обе части на  $\alpha$ .

□

**Теорема 1.5** (Формула интегрирования по частям).  $f, g: \langle a, b \rangle \rightarrow \mathbb{R}$ , дифференцируемые,  $f'g$  имеет первообразную.

Тогда  $fg'$  имеет первообразную и  $\int fg' = fg - \int f'g$

**Доказательство.**  $H$  — первообразная для  $f'g$ . Тогда  $H' = f'g$ .

Надо доказать, что  $fg - H$  — первообразная для  $fg'$ .

$$(fg - H)' = f'g + gh' - H' = f'g + fg' - f'g = fg'.$$

□

## 1.2. Определенный интеграл

Пусть  $\mathcal{F}$  — совокупность (множество) ограниченных плоских фигур.

**Определение 1.3.** Площадь:  $\sigma: \mathcal{F} \rightarrow [0; +\infty)$ , причём

1.  $\sigma([a; b] \times [c; d]) = (b - a)(d - c)$
2. (Аддитивность).  $\forall E_1, E_2 \in \mathcal{F}: E_1 \cap E_2 = \emptyset \Rightarrow \sigma(E_1 \cup E_2) = \sigma(E_1) + \sigma(E_2)$

**Свойство Монотонность площади.**  $\forall E, \tilde{E}: E \subset \tilde{E} \Rightarrow \sigma(E) \leq \sigma(\tilde{E})$ .

**Доказательство.**  $\tilde{E} = E \cup (\tilde{E} \setminus E) \Rightarrow \sigma(\tilde{E}) = \sigma(E) + \sigma(\tilde{E} \setminus E)$ .

□

**Определение 1.4.** Псевдоплощадь:  $\sigma: \mathcal{F} \rightarrow [0; +\infty)$ , причём

1.  $\sigma([a; b] \times [c; d]) = (b - a)(d - c)$ ,
2.  $\forall E, \tilde{E} \in \mathcal{F}: E \subset \tilde{E} \Rightarrow \sigma(E) \leq \sigma(\tilde{E})$ ,
3. Разобьем  $E$  вертикальной или горизонтальной прямой, в том числе теми прямыми, которые правее или левее  $E$ . Тогда  $E = E_- \cup E_+$ ,  $E_- \cap E_+ = \emptyset$  и  $\sigma(E) = \sigma(E_-) + \sigma(E_+)$ .

**Свойства.** 1. Подмножество вертикального или горизонтального отрезка имеет нулевую площадь.

2. В определении  $E_-$  и  $E_+$  неважно куда относить точки из  $l$ .

**Доказательство.** Пусть  $\tilde{E} = E_- \cup (E \cap l) = (E_- \setminus l) \cup (E \cap l)$ .

Тогда  $\sigma(\tilde{E}) = \sigma(E_- \cup (E \cap l)) = \sigma(E_- \setminus l) + \underbrace{\sigma(E \cap l)}_{=0} \Rightarrow$  вообще не имеет разницы куда относить точки из  $l$ .

□

**Пример.**

1.  $\sigma_1(E) = \inf \left\{ \sum_{k=1}^n |P_k| : P_k \text{ — прямоугольник, } \bigcup_{k=1}^n P_k \supset E \right\}$ .
2.  $\sigma_2(E) = \inf \left\{ \sum_{k=1}^{\infty} |P_k| : P_k \text{ — прямоугольник, } \bigcup_{k=1}^{\infty} P_k \supset E \right\}$ .

**Упражнение.**

1. Доказать, что  $\forall E \quad \sigma_1(E) \geq \sigma_2(E)$ .
2.  $E = ([0, 1] \cap \mathbb{Q}) \times ([0, 1] \cap \mathbb{Q})$ . Доказать, что  $\sigma_1(E) = 1, \sigma_2(E) = 0$ .

**Теорема 1.6.**

1.  $\sigma_1$  — квазиплощадь.
2. Если  $E'$  — сдвиг  $E$ , то  $\sigma_1(E) = \sigma_1(E')$ .

**Доказательство.**

2.  $E'$  — сдвиг  $E$  на вектор  $v$ . Пусть  $P_k$  — покрытие  $E \iff P'_k$  — покрытие  $E'$ . Знаем, что площади прямоугольников не меняются при сдвиге, а значит:

$$\sigma_1(E) = \inf\left\{\sum_{k=1}^n |P_k|\right\} = \inf\left\{\sum |P'_k|\right\} = \sigma_1(E').$$

1.  $\Rightarrow$  монотонность. Пусть есть  $E \subset \tilde{E}$ . Тогда возьмем покрытие  $P_k$  для  $\tilde{E}$ .  $E \subset \tilde{E} \subset \bigcup_{k=1}^n P_k$ .

А теперь заметим, что  $\sigma_1 = \inf$ , и любое покрытие для  $\tilde{E}$  является покрытием и для  $E$ , т.е. все суммы из  $\sigma_1(\tilde{E})$  есть в  $\sigma_1(E)$ , а значит  $\sigma_1(E) \leq \sigma_1(\tilde{E})$  как инфимум по более широкому множеству.

- 1'. Докажем теперь аддитивность.

« $\leq$ »:  $\sigma_1(E) = \sigma_1(E_-) + \sigma_1(E_+)$ . Пусть  $P_k$  — покрытие  $E_-$ ,  $Q_j$  — покрытие  $E_+$ .

Тогда  $\bigcup_{k=1}^n P_k \cup \bigcup_{j=1}^n Q_j \supset E_- \cup E_+ = E$ .

А значит  $\sigma_1(E) \leq \inf\left\{\sum_{k=1}^n |P_k| + \sum_{j=1}^n |Q_j|\right\} = \inf\{\sum |P_k|\} + \inf\{\sum |Q_j|\} = \sigma_1(E_-) + \sigma(E_+)$ .

Заметим, что переход с разделением инфимумов возможен, так как  $P$  и  $Q$  выбираются независимо.

« $\geq$ »: Пусть  $P_k$  — покрытие  $E$ . Тогда можно пересечь прямой (покрытие и само  $E$ ) и разбить  $P_k$  на  $P_k^-$  и  $P_k^+$ , а тогда:  $|P_k| = |P_k^-| + |P_k^+|$ ,  $\sum |P_k| = \sum |P_k^-| + \sum |P_k^+|$ .

$\sum |P_k^-| \geq \sigma_1(E_-)$ ,  $\sum |P_k^+| \geq \sigma_1(E_+) \Rightarrow \sum |P_k| \geq \sigma_1(E_-) + \sigma_1(E_+)$  для любого покрытия  $P_k$ , а значит и  $\sigma_1(E) \geq \sigma_1(E_-) + \sigma_1(E_+)$

Таким образом  $\sigma_1(E) = \sigma_1(E_-) + \sigma_1(E_+)$

- 1''. Проверим, что сама площадь прямоугольника не сломалась:  $\sigma_1([a, b] \times [c, d]) = (b-a)(d-c)$ . Заметим, что  $\sigma_1(P) \leq |P|$ , т.к. прямоугольник можно покрыть им самим.

Чтобы доказать  $\sigma_1(P) \geq |P|$ , посмотрим на  $P_k$ . Проведем прямые содержащие все стороны прямоугольников из покрытия (и  $P$ ). Заметим, что такими прямыми каждый прямоугольник разбивается на подпрямоугольники, сумма площадей которых равна площади исходного прямоугольника. Тогда заметим, что и площадь  $P$  это сумма «кусочков из нарезки»  $P$ , и некоторые части разбиения встречаются в  $P_k$  несколько раз. А значит выкинув все лишнее мы как раз получим  $|P|$ , а значит  $\sigma_1(P) \geq |P|$ .

Формально: Если  $\bigcup_{k=1}^n P_k \supset P$ , то  $\sum_{k=1}^n |P_k| \geq |P| \Rightarrow \inf\left\{\sum_{k=1}^n |P_k|\right\} \geq |P|$ .

Таким образом  $\sigma_1(P) = |P|$ .

□

**Определение 1.5.** Пусть  $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ . Тогда  $f_+, f_- : [a, b] \rightarrow [0; +\infty)$ . Причем  $f_+(x) = \max\{f(x), 0\}$ ,  $f_- = \max\{-f(x), 0\}$ .  $f_+$  — положительная составляющая, а  $f_-$  — отрицательная составляющая.

**Свойства.** 1.  $f = f_+ - f_-$ .

2.  $|f| = f_+ + f_-$

3.  $f_+ = \frac{f+|f|}{2}$ ,  $f_- = \frac{|f|-f}{2}$ . (Сложили и вычли первые два свойства)

4. Если  $f \in C([a, b])$ , то  $f_{\pm} \in C([a, b])$ . (Видно из 3-го пункта)

**Определение 1.6.** Пусть  $f: [a, b] \rightarrow [0; +\infty)$ .

Тогда подграфик  $P_f([a; b]) := \{(x, y) \in \mathbb{R}^2 \mid x \in [a, b], 0 \leq y \leq f(x)\}$ . Подграфик может быть взят и от какого-то подотрезка области определения функции!

**Определение 1.7.** Пусть  $f \in C([a, b])$ . Зафиксируем произвольную квазиплощадь  $\sigma$ . Тогда Определённый интеграл:  $\int_a^b f = \int_a^b f(x)dx = \sigma(P_{f_+}([a; b])) - \sigma(P_{f_-}([a; b]))$ .

Определение корректно, поскольку, раз функция непрерывна, то и составляющие непрерывны на отрезке, значит ограничены, значит под  $\sigma$  ограниченные множества, на которых  $\sigma$  определена. А позже проверим, что результат не зависит и от выбора  $\sigma$ .

**Свойства.** 1.  $\int_a^a f = 0$ . (Площадь отрезка = 0)

2.  $\int_a^b c = c(b - a)$ ,  $c \geq 0$  (для отрицательных будет следовать из пунктов ниже)

**Доказательство.** По графику очевидно :) □

3.  $f \geq 0 \Rightarrow \int_a^b f = \sigma(P_f)$ .

4.  $\int_a^b (-f) = -\int_a^b f$ .

**Доказательство.**  $(-f)_+ = \max\{-f, 0\} = f_-$ .  $(-f)_- = \max\{f, 0\} = f_+$ , откуда  $\int_a^b (-f) = \sigma(P_{(-f)_+}) - \sigma(P_{(-f)_-}) = \sigma(P_{f_-}) - \sigma(P_{f_+}) = -\int_a^b f$  □

5.  $f \geq 0 \wedge \int_a^b f = 0 \wedge a < b \Rightarrow f = 0$ .

**Доказательство.** От противного. Пусть  $\exists c \in [a, b]: f(c) > 0$ . Тогда, возьмем  $\varepsilon := \frac{f(c)}{2}$ ,  $\delta$  из определения непрерывности в точке  $c$ . Если  $x \in (c - \delta, c + \delta)$ , то  $f(x) \in (f(c) - \varepsilon, f(c) + \varepsilon) = (\frac{f(c)}{2}, \frac{3f(c)}{2}) \Rightarrow f(x) \geq \frac{f(c)}{2}$  при  $x \in (c - \delta; c + \delta) \Rightarrow P_f \supset [c - \frac{\delta}{2}; c + \frac{\delta}{2}] \times [0; \frac{f(c)}{2}] \Rightarrow \int_a^b f = \sigma(P_f) \geq \delta \cdot \frac{f(c)}{2} > 0$ , противоречие. □

### 1.3. Свойства интеграла

**Теорема 1.7** (Аддитивность интеграла). Пусть  $f: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ ,  $c \in [a, b]$ .

Тогда  $\int_a^b f = \int_a^c f + \int_c^b f$ .

**Доказательство.**  $\int_a^b f = \sigma(P_{f_+}([a, b])) - \sigma(P_{f_-}([a, b]))$ . Разделим наш  $[a, b]$  и соответствующие множества вертикальной прямой  $x = c$ . Тогда  $\sigma(P_{f_+}[a, b]) - \sigma(P_{f_-}[a, b]) = \sigma_{P_{f_+}[a, c]} + \sigma_{P_{f_+}[c, b]} - \sigma(P_{f_-}[a, c]) - \sigma(P_{f_-}[c, b]) = \int_a^c f + \int_c^b f$   $\square$

**Теорема 1.8** (Монотонность интеграла). Пусть  $f, g: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$  и  $\forall x \in [a, b]: f(x) \leq g(x)$ .

$$\text{Тогда } \int_a^b f \leq \int_a^b g.$$

**Доказательство.**  $f_+ = \max\{f, 0\} \leq \max\{g, 0\} = g_+ \Rightarrow P_{f_+} \subset P_{g_+} \Rightarrow \sigma(P_{f_+}) \leq \sigma(P_{g_+})$ .

$$f_- = \max\{-f, 0\} \geq \max\{-g, 0\} = g_- \Rightarrow P_{f_-} \supset P_{g_-} \Rightarrow \sigma(P_{f_-}) \geq \sigma(P_{g_-}).$$

$$\int_a^b f = \sigma(P_{f_+}) - \sigma(P_{f_-}) \leq \sigma(P_{g_+}) - \sigma(P_{g_-}) = \int_a^b g. \quad \square$$

**Следствие.** 1.  $|\int_a^b f| \leq \int_a^b |f|$ .

$$2. (b-a) \min_{x \in [a, b]} f(x) \leq \int_a^b f \leq (b-a) \max_{x \in [a, b]} f(x).$$

**Доказательство.** 1.  $-|f| \leq f \leq |f| \Rightarrow$  (Применим теорему к двум неравенствам)

$$\int_a^b -|f| \leq \int_a^b f \leq \int_a^b |f| \Rightarrow |\int_a^b f| \leq \int_a^b |f|.$$

$$2. m := \min_{x \in [a, b]} f(x), M := \max_{x \in [a, b]} f(x). m \leq f(x) \leq M \Rightarrow \int_a^b m \leq \int_a^b f \leq \int_a^b M \Rightarrow$$

$$m(b-a) \leq \int_a^b f \leq M(b-a).$$

$\square$

**Теорема 1.9** (Интегральная теорема о среднем). Пусть  $f \in C([a, b])$ .

$$\text{Тогда } \exists c \in (a, b): \int_a^b f = (b-a)f(c).$$

**Доказательство.**  $m := \min f = f(p), M := \max f = f(q)$  (по теореме Вейерштрасса). Тогда  $\frac{1}{b-a} \int_a^b f = f(c) \Rightarrow f(p) \leq \frac{1}{b-a} \int_a^b f \leq f(q) \xrightarrow{\text{т. Б-К}} \exists c \in (p, q) \text{ или } (q, p): f(c) = \frac{1}{b-a} \int_a^b f$ .  $\square$

**Определение 1.8.**  $I_f := \frac{1}{b-a} \int_a^b f$  — среднее значение  $f$  на отрезке  $[a, b]$ .

**Определение 1.9.**  $f: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ . Интеграл с переменным верхним пределом  $\Phi(x) := \int_a^x f$ , где  $x \in [a, b]$ .

**Определение 1.10.**  $f: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ . Интеграл с переменным нижним пределом  $\Psi(x) := \int_x^b f$ , где  $x \in [a, b]$ .

**Замечание.**  $\Phi(x) + \Psi(x) = \int_a^b f$ .

**Теорема 1.10** (Теорема Барроу). Пусть  $f \in C([a, b])$ . Тогда  $\Phi'(x) = f(x) \quad \forall x \in [a, b]$ . То есть  $\Phi$  — первообразная функции  $f$ .

**Доказательство.** Надо доказать, что  $\lim_{y \rightarrow x} \frac{\Phi(y) - \Phi(x)}{y - x} = f(x)$ . Проверим для предела справа (слева аналогично, но, возможно, с чуть другим порядком точек).

$$\text{Тогда } \Phi(y) - \Phi(x) = \int_a^y f - \int_a^x f = \int_x^y f.$$

Тогда  $\frac{\Phi(y) - \Phi(x)}{y - x} = \frac{1}{y - x} \int_x^y f = f(c)$  для некоторого  $c \in (x, y)$  по интегральной теореме о среднем.

Проверяем определение по Гейне. Берем  $y_n > x$  и  $y_n \rightarrow x$ . Тогда  $\frac{\Phi(y_n) - \Phi(x)}{y_n - x} = f(c_n)$ , где  $c_n \in (x, y_n)$ ,  $x < c_n < y_n \rightarrow x \Rightarrow c_n \rightarrow x \Rightarrow$  в силу непрерывности  $f$   $f(c_n) \rightarrow f(x)$ .  $\square$

**Следствие.**  $\Psi'(x) = -f(x) \quad \forall x \in [a, b]$ .

**Доказательство.**  $\Psi(x) = \int_a^b f - \Phi(x) = C - \Phi(x) \Rightarrow \Psi' = (C - \Phi(x))' = -\Phi'(x) = -f(x)$ .  $\square$

**Теорема 1.11.** Непрерывная на промежутке функция имеет первообразную.

**Доказательство.**  $f: \langle a, b \rangle \rightarrow \mathbb{R}$ .

$$\text{Возьмём } c \in (a, b) \text{ Рассмотрим } F(x) := \begin{cases} \int_c^x f & \text{при } x \geq c \\ -\int_x^c f & \text{при } x \leq c \end{cases}.$$

Утверждаем, что  $F(x)$  — первообразная  $f(x)$ . Если  $x > c$ , то  $F'(x) = f(x)$ . Если  $x < c$ , то  $F'(x) = -(-f(x)) = f(x)$ . Если  $x = c$ , то, так как производные слева и справа считаются правильно и равны, то и в этой точке производная есть  $f(x)$ .  $\square$

**Теорема 1.12** (Формула Ньютона-Лейбница).  $f: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$  и  $F$  — её первообразная. Тогда  $\int_a^b f = F(b) - F(a)$ .

**Доказательство.**  $\Phi(x) = \int_a^x f$  — первообразная и  $F(x) = \Phi(x) + C$  (знаем, что две первообразные отличаются на константу)

$$\text{Тогда } F(b) - F(a) = (\Phi(b) + C) - (\Phi(a) + C) = \Phi(b) - \Phi(a) = \int_a^b f \quad \square$$

И ровно в этот момент мы поняли, что от выбора псевдоплощади не зависим, поскольку первообразные от них не зависят (отсылка к первому билету/началу конспекта про псевдоплощади)

**Определение 1.11.**  $F|_a^b := F(b) - F(a)$

**Теорема 1.13** (Линейность интеграла).  $\int_a^b (\alpha f + \beta g) = \alpha \int_a^b f + \beta \int_a^b g$ .

**Доказательство.** Пусть  $F, G$  — первообразные для  $f, g$ .



Тогда  $\alpha F + \beta G$  — первообразная для  $\alpha f + \beta g$ . Тогда воспользуемся формулой Ньютона-Лейбница:

$$\int_a^b \alpha f + \beta g = (\alpha F + \beta G)|_a^b = \alpha F(b) + \beta G(b) - \alpha F(a) - \beta G(a) = \alpha \int_a^b f + \beta \int_a^b g.$$

□

**Теорема 1.14** (Формула интегрирования по частям). Пусть  $f, g \in C^1[a, b]$ .

$$\text{Тогда } \int_a^b f g' = f g |_a^b - \int_a^b f' g.$$

**Доказательство.** Докажем при помощи формулы Ньютона-Лейбница. Пусть  $H$  — первообразная  $f'g$ . Тогда  $f g - H$  — первообразная для  $f g'$ .

Проверим данный факт:  $(f g - H)' = f'g + f g' - f'g = f g'$ . А значит нам можно воспользоваться формулой Ньютона-Лейбница.

$$\int_a^b f g' = (f g - H) |_a^b = f g |_a^b - H |_a^b = f g |_a^b - \int_a^b f' g.$$

□

**Замечание Соглашение.** Если  $a > b$ , то  $\int_a^b f := - \int_b^a f$ .

Мотивация: Если  $F$  — первообразная, то  $\int_a^b f = F |_a^b$ .

**Теорема 1.15** (Формула замены переменной). Пусть  $f \in C[a, b]$ ,  $\varphi: [c, d] \rightarrow [a, b]$ ,  $\varphi \in C^1[c, d]$ ,  $p, q \in [c, d]$ .

$$\text{Тогда } \int_p^q f(\varphi(t))\varphi'(t)dt = \int_{\varphi(p)}^{\varphi(q)} f(x)dx.$$

**Доказательство.** Пусть  $F$  — первообразная  $f$ . Тогда  $\int_{\varphi(p)}^{\varphi(q)} f(x)dx = F |__{\varphi(p)}^{\varphi(q)} = F \circ \varphi |_p^q$ . Заметим, что  $F \circ \varphi$  — первообразная для  $f(\varphi(t))\varphi'(t)$ .

Проверим это:  $(F(\varphi(t)))' = F'(\varphi(t)) \cdot \varphi'(t) = f(\varphi(t))\varphi'(t)$ .

$$\text{Тогда: } \int_{\varphi(p)}^{\varphi(q)} f(x)dx = F \circ \varphi |_p^q = \int_p^q f(\varphi(t))\varphi'(t)dt$$

□

**Пример.**

$$\int_0^{\frac{\pi}{2}} \frac{\sin 2t}{1 + \sin^4 t} dt. \quad (1)$$

Произведем замену  $\varphi(t) = \sin^2 t$ ,  $f(x) = \frac{1}{1+x^2}$ ,  $\varphi'(t) = 2 \sin t \cos t = \sin 2t$ ,  $\varphi(0) = 0$ ,  $\varphi(\frac{\pi}{2}) = 1$ :

$$(1) = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \frac{\varphi'(t)}{1 + (\varphi(t))^2} = \int_0^{\frac{\pi}{2}} f(\varphi(t))\varphi'(t)dt = \int_{\varphi(0)}^{\varphi(\frac{\pi}{2})} f(x)dx = \int_0^1 f(x)dx = \int_0^1 \frac{dx}{1+x^2} = \arctg x |_0^1 = \frac{\pi}{4}.$$

## 1.4. Приложения формулы интегрирования по частям

**Пример.**  $W_n := \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^n x dx = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \cos^n t dt = (1)$  Докажем этот момент:

Положим  $x = \frac{\pi}{2} - t =: \varphi(t)$ ,  $\varphi'(t) = -1$ ,  $\sin(\frac{\pi}{2} - t) = \cos t$ .

Тогда  $(1) = - \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^n \varphi(t) \cdot \varphi'(t) dt = \int_{\frac{\pi}{2}}^0 \sin^n x dx$

Частные случаи  $W_0 = \frac{\pi}{2}$ ,  $W_1 = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin x dx = -\cos x \Big|_0^{\frac{\pi}{2}} = 1$

Общее решение:  $W_n = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^n x dx = - \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^{n-1} x \cdot (\cos x)' dx = (*)$ . Воспользовались тем, что  $\sin x = -(\cos x)'$ ,  $f'(x) = (n-1) \sin^{n-2} x \cdot \cos x$ .

Тогда получаем:

$$\begin{aligned} (*) &= - \left( \underbrace{\sin^{n-1} x \cdot \cos x \Big|_0^{\frac{\pi}{2}}}_{=0} - \int_0^{\frac{\pi}{2}} (n-1) \sin^{n-2} x \underbrace{\cos^2 x}_{=1-\sin^2 x} dx \right) = \\ &= (n-1) \left( \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^{n-2} x dx - \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^n x dx \right) = (n-1)(W_{n-2} - W_n). \end{aligned}$$

Посчитаем для четных:  $W_{2n} = \frac{2n-1}{2n} \cdot W_{2n-2} = \frac{2n-1}{2n} \cdot \frac{2n-3}{2n-2} W_{2n-4} = \dots = \frac{(2n-1)!!}{(2n)!!} \frac{\pi}{2}$ , где  $k!!$  — произведение натуральных чисел  $\leq k$  той же четности, что и  $k$ .

Для нечетных:  $W_{2n+1} = \frac{2n}{2n+1} W_{2n-1} = \frac{2n}{2n+1} \cdot \frac{2n-2}{2n-1} W_{2n-3} = \dots = \frac{(2n)!!}{(2n+1)!!} W_1 = \frac{(2n)!!}{(2n+1)!!}$

**Теорема 1.16** (Формула Валлиса).

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{(2n)!!}{(2n-1)!!} \cdot \frac{1}{\sqrt{2n+1}} = \sqrt{\frac{\pi}{2}}.$$

**Доказательство.**  $\sin^n x \geq \sin^{n+1} x$  на  $[0, \frac{\pi}{2}]$ . Тогда  $W_n = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^n x dx \geq \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin^{n+1} x dx = W_{n+1}$ .

Заметим, что  $W_{2n+2} \leq W_{2n+1} \leq W_{2n} \iff \frac{\pi}{2} \frac{(2n+1)!!}{(2n+2)!!} \leq \frac{(2n)!!}{(2n+1)!!} \leq \frac{\pi}{2} \frac{(2n-1)!!}{(2n)!!}$ . Поделим на  $\frac{(2n-1)!!}{(2n)!!}$ :

$$\frac{\pi}{2} \frac{2n+1}{2n+2} \leq \frac{((2n)!!)^2}{(2n+1)((2n-1)!!)^2} \leq \frac{\pi}{2} \implies \lim \left( \frac{(2n)!!}{\sqrt{(2n+1)(2n-1)!!}} \right)^2 = \frac{\pi}{2}.$$

Последний переход — по двум милиционерам, т.к. при  $n \rightarrow +\infty$   $\frac{2n+1}{2n+2} \rightarrow 1$  □

**Следствие.**

$$\binom{2n}{n} = \frac{(2n)!}{(n!)^2} \sim \frac{4^n}{\sqrt{\pi n}}.$$

**Доказательство.** Заметим, что  $(2n)! = (2n)!! \cdot (2n-1)!!$ , а  $(2n)!! = 2 \cdot 4 \cdot 6 \cdot \dots \cdot (2n) = 2^n \cdot n!$ . Тогда подставим в Сшку:

$$\binom{2n}{n} = \frac{(2n)!!(2n-1)!!}{\frac{(2n)!!}{2^n} \frac{(2n)!!}{2^n}} = 4^n \cdot \frac{(2n-1)!!}{(2n)!!}.$$

При этом из Валлиса, заметим, что  $\frac{(2n)!!}{(2n-1)!!} \sim \sqrt{\frac{\pi}{2}}\sqrt{2n+1} \sim \sqrt{\frac{\pi}{2}}\sqrt{2n} = \sqrt{\pi n}$ . А значит все сойдется.  $\square$

**Теорема 1.17** (Формула Тейлора (с остатком в интегральной форме)). Пусть  $f \in C^{n+1}[a, b]$ ,  $x, x_0 \in [a, b]$ . Тогда:

$$f(x) = \sum_{k=0}^n \frac{f^{(k)}(x_0)}{k!} (x - x_0)^k + \frac{1}{n!} \int_{x_0}^x (x - t)^n f^{(n+1)}(t) dt.$$

**Доказательство.** Индукция по  $n$ :

- База.  $n = 0$ ,  $f(x) = f(x_0) + \int_{x_0}^x f'(t) dt = f(x_0) + f' \Big|_{x_0}^x$
- Переход.  $n \rightarrow n + 1$ .
- Доказательство.  $f(x) = T_n(x) + \frac{1}{n!} \int_{x_0}^x \underbrace{(x - t)^n}_{g'} \underbrace{f^{(n+1)}(t)}_f dt$ . Проинтегрируем интеграл по частям.

$$g(t) = -\frac{(x-t)^{n+1}}{n+1}.$$

$$\begin{aligned} \text{Подставим: } \int_{x_0}^x (x - t)^n f^{(n+1)}(t) dt &= -\frac{(x-t)^{n+1}}{n+1} \cdot f^{(n+1)}(t) \Big|_{t=x_0}^{t=x} + \int_{x_0}^x \frac{1}{n+1} (x - t)^{n+1} \cdot f^{(n+2)}(t) dt = \\ &= \underbrace{\frac{1}{n+1} (x - x_0)^{n+1} f^{(n+1)}(x_0)}_{\text{новый член Тейлора!}} + \int_{x_0}^x \frac{1}{n+1} (x - t)^{n+1} \cdot f^{(n+2)}(t) dt \end{aligned}$$

Вспомнив, что у нас там ещё был  $\frac{1}{n!}$  перед исходным интегралом заметим, что мы действительно получили новый член суммы и новый интеграл с  $\frac{1}{(n+1)!}$ , что доказывает индукционный переход.  $\square$

**Пример.**

$$H_j := \frac{1}{j!} \int_0^{\frac{\pi}{2}} \left( \left( \frac{\pi}{2} \right)^2 - x^2 \right)^j \cos x dx. \quad (2)$$

$$\text{Свойство 1. } 0 < H_j \leq \frac{1}{j!} \left( \frac{\pi}{2} \right)^{2j} \int_0^{\frac{\pi}{2}} \cos x dx = \frac{\left( \frac{\pi}{2} \right)^{2j}}{j!}.$$

$$\text{Свойство 2. } \forall c > 0: c^j \cdot H_j \xrightarrow{j \rightarrow \infty} 0. \quad 0 < c^j H_j \leq \frac{\left( \frac{\pi}{2} \right)^{2j} \cdot c^j}{j!} = \frac{\left( \frac{\pi^2}{4} c \right)^j}{j!} \rightarrow 0.$$

$$\text{Свойство 3. } H_0 = 1, H_1 = 2 \text{ (упражнение).}$$

$$\text{Свойство 4. } H_j = (4j - 2)H_{j-1} - \pi^2 H_{j-2}, \text{ при } j \geq 2.$$

**Доказательство.**

$$j! H_j = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \left( \left( \frac{\pi}{2} \right)^2 - x^2 \right)^j (\sin x)' dx \quad (3)$$

Заметим, что  $\left(\left(\left(\frac{\pi}{2}\right)^2 - x^2\right)^j\right)' = j \left(\left(\frac{\pi}{2}\right)^2 - x^2\right)^{j-1} \cdot (-2x)$ . Тогда:

$$\begin{aligned}
 (3) &= \underbrace{\left(\left(\frac{\pi}{2}\right)^2 - x^2\right)^j \sin x \Big|_{x=0}^{x=\frac{\pi}{2}}}_{=0} + 2j \int_0^{\frac{\pi}{2}} \left(\left(\frac{\pi}{2}\right)^2 - x^2\right)^{j-1} x \underbrace{\sin x}_{=(-\cos x)'} dx = \\
 &= 2j \left( \underbrace{\left(\left(\frac{\pi}{2}\right)^2 - x^2\right)^{j-1} \cdot x \cdot (-\cos x) \Big|_{x=0}^{x=\frac{\pi}{2}}}_{=0} - \int_0^{\frac{\pi}{2}} \left( (j-1) \left(\left(\frac{\pi}{2}\right)^2 - x^2\right)^{j-2} (-2x)x + \left(\left(\frac{\pi}{2}\right)^2 - x^2\right)^{j-1} (-\cos x) \right) dx \right) \\
 &= 2j \left( (j-1)!H_{j-1} - 2(j-1) \int_0^{\frac{\pi}{2}} \left(\left(\frac{\pi}{2}\right)^2 - x^2\right)^{j-2} x^2 \cos x dx \right).
 \end{aligned}$$

В процессе мы дважды интегрировали по частям, а теперь нужно избавиться во втором слагаемом от  $x^2$ . Для этого заметим, что  $x^2 = \left(\frac{\pi}{2}\right)^2 - \left(\left(\frac{\pi}{2}\right)^2 - x^2\right)$ , подставим и разобьём интеграл на два, которые есть  $H_{j-2}$  и  $H_{j-1}$  с нужными коэффициентами:

$$j!H_j = 2j(j-1)!H_{j-1} - 4j(j-1) \left( ((j-2)! \left(\frac{\pi}{2}\right)^2) H_{j-2} - (j-1)!H_{j-1} \right)$$

Откуда с легкостью получаем  $j!H_j = 2j!H_{j-1} - \pi^2 j!H_{j-2} + 4(j-1)j!H_{j-1} \iff H_j = (4j-2)H_{j-1} - \pi^2 H_{j-2}$ .

**Свойство 5.** Существует многочлен  $P_n$  с целыми коэффициентами степени  $\leq n$ , такой что  $H_j = P_j(\pi^2)$ .

**Доказательство.**  $P_0 \equiv 1, P_1 \equiv 2, P_n(x) = (4n-2)P_{n-1}(x) - xP_{n-2}(x)$ . □

□

**Теорема 1.18** (Ламберта, доказательство: Эрмит). Числа  $\pi$  и  $\pi^2$  иррациональные.

**Доказательство.** От противного. Пусть  $\pi^2$  — рационально. Тогда пусть  $\pi^2 = \frac{m}{n}$ . Тогда  $H_j = P_j\left(\frac{m}{n}\right) = \frac{\text{целое число}}{n^j} > 0$ .

$n^j H_j = \text{целое число} > 0 \Rightarrow n^j H_j \geq 1$

Но, по свойству 2, при  $j \rightarrow +\infty$   $n^j H_j \rightarrow 0$ , противоречие. □

# Отступление. Равномерная непрерывность

**Определение 1.12.**  $f: E \subset \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  равномерно непрерывна на  $E$ , если  $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall x, y \in E: |x - y| < \delta \Rightarrow |f(x) - f(y)| < \varepsilon$

**Определение 1.13.**  $f$  непрерывна во всех точках из  $E$ :  
 $\forall x \in E \forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall y \in E: |x - y| < \delta \Rightarrow |f(x) - f(y)| < \varepsilon$

**Пример.**  $\sin x$  и  $\cos x$  равномерно непрерывны на  $\mathbb{R}$ .

$$|\sin x - \sin y| \leq |x - y| \Rightarrow \delta = \varepsilon \text{ подходит. } |\cos x - \cos y| \leq |x - y|.$$

**Пример.**  $f(x) = x^2$  не является равномерно непрерывной на  $\mathbb{R}$ . Рассмотрим  $\varepsilon = 1$ , никакое  $\delta > 0$  не подходит.  $x$  и  $x + \frac{\delta}{2}$ .  $f(x + \frac{\delta}{2}) - f(x) = (x + \frac{\delta}{2})^2 - x^2 = \dots = \delta x + \frac{\delta^2}{4} > \delta x$ . При  $x = \frac{1}{\delta}$  противоречие.

**Теорема 1.19** (Теорема Кантора). Пусть  $f \in C[a, b]$ , тогда  $f$  равномерно непрерывна на  $[a, b]$ .

**Доказательство.** Берем  $\varepsilon > 0$  и предположим, что  $\delta = \frac{1}{n}$  не подходит, то есть  $\exists x_n, y_n \in [a, b]: |x_n - y_n| < \frac{1}{n}$  и  $|f(x_n) - f(y_n)| \geq \varepsilon$ . По теореме Больцано-Вейерштрасса у последовательности  $x_n$  есть сходящаяся подпоследовательность  $x_{n_k} \rightarrow c$ , то есть  $\lim x_{n_k} = c \in [a, b]$ .

$$\underbrace{x_{n_k} - \frac{1}{n_k}}_{\rightarrow c} < y_{n_k} < \underbrace{x_{n_k} + \frac{1}{n_k}}_{\rightarrow c} \Rightarrow \lim y_{n_k} = c. \text{ Но } f \text{ непрерывна в точке } c \Rightarrow \lim f(x_{n_k}) = f(c) = \lim f(y_{n_k}) \Rightarrow \lim (f(x_{n_k}) - f(y_{n_k})) = 0, \text{ но } |f(x_{n_k}) - f(y_{n_k})| \geq \varepsilon. \quad \square$$

**Замечание.** Для интервала или полуинтервала неверно.  $f(x) = \frac{1}{x}$  на  $(0; 1]$ . Докажем, что нет равномерной непрерывности на  $(0; 1]$ .

$$\text{Пусть } \varepsilon = 1 \text{ и } \delta > 0. \text{ Пусть } 0 < x < \delta, y = \frac{x}{2}, |x - y| = \frac{x}{2} < \delta. \text{ Тогда } f(y) - f(x) = \frac{2}{x} - \frac{1}{x} = \frac{1}{x} > 1.$$

**Определение 1.14.** Пусть  $f: E \subset \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ .

Тогда  $\omega_f(\delta) := \sup\{|f(x) - f(y)| \mid \forall x, y \in E, |x - y| \leq \delta\}$  — модуль непрерывности  $f$ .

**Свойства.** 1.  $\omega_f(0) = 0$ ,

$$2. |f(x) - f(y)| \leq \omega_f(|x - y|).$$

$$3. \omega_f \uparrow.$$

$$4. \text{ Если } f \text{ — липшицева функция с константой } L, \text{ то } \omega_f(\delta) \leq L\delta.$$

$$\text{В частности, если } |f'(x)| \leq L \quad \forall x \in \langle a, b \rangle.$$

$$5. f \text{ равномерна и непрерывна на } E \iff \omega_f \text{ непрерывна в нуле} \iff \lim_{\delta \rightarrow 0+} \omega_f(\delta) = 0.$$

**Доказательство.** •  $1 \rightarrow 2$ .  $\forall \varepsilon > 0 \exists \gamma > 0 \forall x, y \in E: |x - y| < \gamma \Rightarrow |f(x) - f(y)| < \varepsilon$ .

Возьмем  $\delta < \gamma$ . Тогда  $|x - y| \leq \delta \Rightarrow |x - y| < \gamma \Rightarrow |f(x) - f(y)| < \varepsilon \Rightarrow \sup \leq \varepsilon$ . Тогда с одной стороны  $\omega_f \geq 0$ , а с другой ограничена  $\varepsilon$ . Следовательно предел  $\omega_f$  равен 0.

•  $2 \rightarrow 1$ . Из  $\lim_{\delta \rightarrow 0+} \omega_f(\delta) = 0$ . Возьмем  $\delta > 0$  для  $\omega_f(\delta) < \varepsilon: |f(x) - f(y)| \leq \omega_f(\delta) < \varepsilon \quad \forall \varepsilon, \forall x, y \in E: |x - y| \leq \delta$ .

□

$$6. f \in C[a, b] \iff \omega_f \text{ непрерывен в нуле} \iff \lim_{\delta \rightarrow 0+} \omega_f(\delta) = 0.$$

**Доказательство.** Для функции на отрезке равномерная непрерывность  $\iff$  непрерывность  $\iff$  теорема Кантора.  $\square$

# Продолжение главы 1

## 1.5. Интегральные суммы

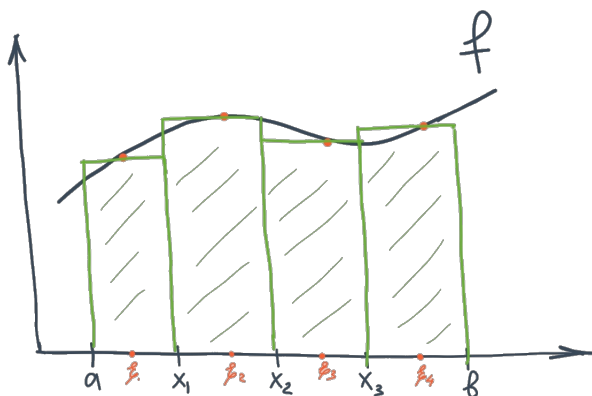
**Определение 1.15.** Пусть есть  $[a, b]$ . Тогда дробление (разбиение, пунктир) отрезка: набор точек:  $x_0 = a < x_1 < x_2 < \dots < x_n = b$ .

**Определение 1.16.** Ранг дробления:  $\max_{k=1,2,\dots,n} (x_k - x_{k-1}) =: |\tau|$ ,  $\tau = (x_0, x_1, \dots, x_n)$

**Определение 1.17.** Оснащение дробления — набор точек  $\xi = (\xi_1, \xi_2, \dots, \xi_n)$ , такой что  $\xi_k \in [x_{k-1}, x_k]$ .

**Определение 1.18.** Интегральная сумма (сумма Римана)  $S(f, \tau, \xi) := \sum_{k=1}^n f(\xi_k)(x_k - x_{k-1})$ ,

По факту просто сумма площадей прямоугольников под графиком



**Теорема 1.20** (Теорема об интегральных суммах). Пусть  $f \in C[a, b]$ ,

тогда  $\left| \int_a^b f - S(f, \tau, \xi) \right| \leq (b - a)\omega_f(|\tau|)$ .

**Доказательство.**

$$\Delta := \int_a^b f - \sum_{k=1}^n f(\xi_k)(x_k - x_{k-1}) = \sum_{k=1}^n \int_{x_{k-1}}^{x_k} f(t)dt - \sum_{k=1}^n \int_{x_{k-1}}^{x_k} f(\xi_k)dt = \sum_{k=1}^n \int_{x_{k-1}}^{x_k} (f(t) - f(\xi_k))dt.$$

$$|\Delta| \leq \sum \left| \int \dots \right| \leq \sum_{k=1}^n \int_{x_{k-1}}^{x_k} |f(t) - f(\xi_k)|dt \leq \sum_{k=1}^n (x_k - x_{k-1})\omega_f(|\tau|) = (b - a)\omega_f(|\tau|).$$

$$\int_{x_{k-1}}^{x_k} |f(t) - f(\xi_k)|dt \leq \int_{x_{k-1}}^{x_k} \omega_f(|\tau|)dt = (x_k - x_{k-1})\omega_f(|\tau|)..$$

□

**Следствие.**  $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall$  дробления ранга  $\leq \delta \forall$  оснащения  $\left| \int_a^b f - S(f, \tau, \xi) \right| < \varepsilon$

**Следствие.** Если  $\tau_n$  — последовательность дроблений, ранг которых  $\rightarrow 0$ , то  $S(f, \tau_n, \xi_n) \rightarrow \int_a^b f$ .

**Пример.**  $S_p(n) := 1^p + 2^p + \dots + n^p$ . Посчитаем  $\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{S_p(n)}{n^{p+1}}$ .

Возьмем  $f: [0, 1] \rightarrow \mathbb{R}$   $f(t) = t^p$   $\frac{S_p(n)}{n^{p+1}} = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n \left(\frac{k}{n}\right)^p = S(f, \tau, \xi)$ , где  $x_k = \xi_k = \frac{k}{n}$ .

Тогда  $\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{S_p(n)}{n^{p+1}} = \int_0^1 t^p dt = \frac{t^{p+1}}{p+1} \Big|_{t=0}^{t=1} = \frac{1}{p+1}$

**Определение 1.19.** Пусть  $f: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ , тогда  $f$  интегрируема по Риману, если  $\exists I \in \mathbb{R} \forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall$  дробления ранга  $< \delta \forall$  его оснащения  $|S(f, \tau, \xi) - I| < \varepsilon$ .

$I$  — интеграл по Риману  $\int_a^b f$ .

**Лемма.**  $f \in C^2[\alpha, \beta]$ . Тогда

$$\int_{\alpha}^{\beta} f(t) dt - \frac{f(\alpha) + f(\beta)}{2} (\beta - \alpha) = -\frac{1}{2} \int_{\alpha}^{\beta} f''(t) (t - \alpha) (\beta - t) dt.$$

**Доказательство.** Пусть  $\gamma := \frac{\alpha + \beta}{2}$ . Тогда:

$$\int_{\alpha}^{\beta} f(t) dt = \int_{\alpha}^{\beta} f(t) (t - \gamma)' dt = f(t) (t - \gamma) \Big|_{t=\alpha}^{t=\beta} - \int_{\alpha}^{\beta} f'(t) (t - \gamma) dt.$$

Заметим, что  $f(t) (t - \gamma) \Big|_{t=\alpha}^{t=\beta} = f(\beta) (\beta - \gamma) - f(\alpha) (\alpha - \gamma) = \frac{f(\alpha) + f(\beta)}{2} (\beta - \alpha)$ . Продолжим:

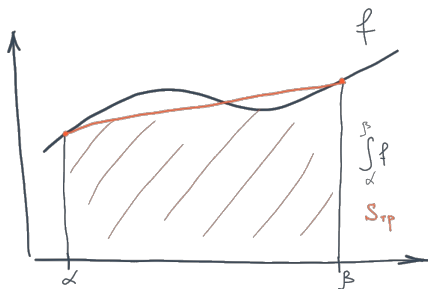
$$\begin{aligned} \text{левая часть} &= - \int_{\alpha}^{\beta} f'(t) (t - \gamma) dt = \frac{1}{2} \int_{\alpha}^{\beta} f'(t) ((t - \alpha) (\beta - t))' dt = \\ &= \frac{1}{2} f'(t) (t - \alpha) (\beta - t) \Big|_{t=\alpha}^{t=\beta} - \frac{1}{2} \int_{\alpha}^{\beta} f''(t) (t - \alpha) (\beta - t) dt. \end{aligned}$$

Переход к  $((t - \alpha) (\beta - t))'$ :

$$((t - \alpha) (\beta - t))' = (-t^2 + (\alpha + \beta)t - \alpha\beta)' = -2t + (\alpha + \beta) = -2(t - \gamma).$$

□

**Замечание.**  $\frac{f(\alpha) + f(\beta)}{2} (\beta - \alpha)$  — площадь трапеции:





**Теорема 1.21** (Оценка погрешности в формуле трапеции). Пусть  $f \in C^2[a, b]$ .

Тогда :

$$\left| \int_a^b f(t)dt - \sum_{k=1}^n \frac{f(x_{k-1}) + f(x_k)}{2} (x_k - x_{k-1}) \right| \leq \frac{|\tau|^2}{8} \int_a^b |f''|$$

**Доказательство.**  $\Delta := \int_a^b - \sum \dots = \sum_{k=1}^n \int_{x_{k-1}}^{x_k} f(t)dt - \sum_{k=1}^n \frac{f(x_{k-1}) + f(x_k)}{2} (x_k - x_{k-1})$

$$|\Delta| \leq \sum_{k=1}^n \left| \int_{x_{k-1}}^{x_k} f(t)dt - \frac{f(x_{k-1}) + f(x_k)}{2} (x_k - x_{k-1}) \right| = \frac{1}{2} \sum_{k=1}^n \left| \int_{x_{k-1}}^{x_k} f''(t)(t - x_{k-1})(x_k - t)dt \right|. \quad (4)$$

Тогда вспомним, что  $(t - x_{k-1})(x_k - t) \leq \left(\frac{x_k - x_{k-1}}{2}\right)^2 \leq \frac{|\tau|^2}{4} \implies (4) \leq \frac{1}{2} \sum_{k=1}^n \int_{x_{k-1}}^{x_k} |f''(t)| \cdot \frac{|\tau|^2}{4} dt = \frac{|\tau|^2}{8} \sum_{k=1}^n \int_{x_{k-1}}^{x_k} |f''| = \frac{|\tau|^2}{8} \cdot \int_a^b |f''|$  □

**Замечание.** Пусть разбиение на  $n$  равных отрезков  $x_k - x_{k-1} = \frac{b-a}{n} = |\tau|$ :

$$\sum_{k=1}^n \frac{f(x_{k-1}) + f(x_k)}{2} (x_k - x_{k-1}) = \frac{b-a}{n} \sum_{k=1}^n \frac{f(x_{k-1}) + f(x_k)}{2} = \frac{b-a}{n} \left( \frac{f(x_0)}{2} + \sum_{k=1}^{n-1} f(x_k) + \frac{f(x_n)}{2} \right).$$

**Замечание.** Возьмем разбиение на равные отрезки и  $\xi_k = x_k$ :

$$S(f, \tau, \xi) = \sum_{k=1}^n f(\xi_k)(x_k - x_{k-1}) = \frac{b-a}{n} \sum_{k=1}^n f(x_k).$$

**Теорема 1.22** (формула Эйлера-Маклорена). Пусть  $f \in C^2[m, n]$ , тогда

$$\sum_{k=m}^n f(k) = \frac{f(m) + f(n)}{2} + \int_m^n f(t)dt + \frac{1}{2} \int_m^n f''(t)\{t\}(1 - \{t\})dt.$$

**Доказательство.** Подставим  $\alpha = k$  и  $\beta = k + 1$  в лемму:

$$\begin{aligned} \int_k^{k+1} f(t)dt &= \frac{f(k) + f(k+1)}{2} - \frac{1}{2} \int_k^{k+1} f''(t)(t - k)(k + 1 - t)dt = \\ &= \frac{f(k) + f(k+1)}{2} - \frac{1}{2} \int_k^{k+1} f''(t)\{t\}(1 - \{t\})dt. \end{aligned}$$

Дальше суммируем по  $k$  от  $m$  до  $n - 1$ :

$$\int_m^n f(t)dt = \sum_{k=m}^{n-1} \frac{f(k) + f(k+1)}{2} - \frac{1}{2} \int_m^n f''(t)\{t\}(1 - \{t\})dt.$$

Заметим, что  $\sum_{k=m}^{n-1} \frac{f(k) + f(k+1)}{2} = \frac{f(m) + f(n)}{2} + \sum_{k=m+1}^{n-1} f(k)$ . И тогда:

$$\sum_{k=m}^n f(k) = \frac{f(m) + f(n)}{2} + \int_m^n f(t)dt + \frac{1}{2} \int_m^n f''(t)\{t\}(1 - \{t\})dt.$$

□

**Пример.**  $S_p(n) = 1^p + 2^p + \dots + n^p$ ,  $f(t) = t^p$ ,  $m = 1$ ,  $f''(t) = p(p-1)t^{p-2}$ .

$$S_p(n) = \frac{1+n^p}{2} + \int_1^n t^p dt + \frac{1}{2} \int_1^n p(p-1)t^{p-2}\{t\}(1-\{t\})dt.$$

$$\text{При } p \in (-1, 1) \int_1^n t^p dt = \frac{t^{p+1}}{p+1} \Big|_1^n = \frac{n^{p+1}}{p+1} - \frac{1}{p+1} = \frac{n^{p+1}}{p+1} + \mathcal{O}(1).$$

$$\int_1^n \underbrace{t^{p-2}\{t\}(1-\{t\})}_{\leq \frac{1}{4}} dt \leq \frac{1}{4} \int_1^n t^{p-2} dt = \frac{1}{4} \cdot \frac{t^{p-1}}{p-1} \Big|_1^n = \frac{1}{4} \cdot \frac{n^{p-1}-1}{p-1} = \mathcal{O}(1).$$

$$\text{То есть } S_p(n) = \frac{n^{p+1}}{p+1} + \frac{n^p}{2} + \mathcal{O}(1).$$

$$\text{При } p > 1 \quad S_p(n) = \frac{n^{p+1}}{p+1} + \frac{n^p}{2} + \mathcal{O}(n^{p-1}).$$

**Пример.** Гармонические числа:  $H_n := 1 + \frac{1}{2} + \frac{1}{3} + \dots + \frac{1}{n}$ .  $m = 1$ ,  $f(t) = \frac{1}{t}$ ,  $f''(t) = \frac{2}{t^3}$ .

$$H_n = \frac{1 + \frac{1}{n}}{2} + \int_1^n \frac{dt}{t} + \frac{1}{2} \int_1^n \frac{2}{t^3} \{t\}(1-\{t\})dt$$

$$\text{Откуда получаем } (a_n := \int_1^n \frac{\{t\}(1-\{t\})}{t^3}; \int_1^n \frac{dt}{t} = \ln t \Big|_1^n = \ln n):$$

$$H_n = \ln n + \frac{1}{2} + \frac{1}{2n} + a_n.$$

$$\text{Заметим, что } a_{n+1} = a_n + \int_n^{n+1} \frac{\{t\}(1-\{t\})}{t^3} dt > a_n. \text{ То есть } a_n \uparrow. \text{ Причем } a_n \leq \int_1^n \frac{dt}{t^3} = -\frac{1}{2t^2} \Big|_1^n = \frac{1}{2} - \frac{1}{2n^2} < \frac{1}{2}.$$

А значит  $a_n$  имеет предел, а значит  $a_n = a + o(1)$ .

Вывод:  $H_n = \ln n + \gamma + o(1)$ , где  $\gamma \approx 0.5772156649$  — постоянная Эйлера.

**Замечание.**  $H_n = \ln n + \gamma + \frac{1}{2n} + \mathcal{O}(\frac{1}{n^2})$  — точная формула.

**Пример Формула Стирлинга.**  $m = 1$ ,  $f(t) = \ln t$ ,  $f''(t) = -\frac{1}{t^2}$ .

$$\ln n! = \sum_{k=1}^n \ln k = \underbrace{\frac{\ln 1 + \ln n}{2}}_{=\frac{1}{2} \ln n} + \underbrace{\int_1^n \ln t dt}_{=t \ln t - t \Big|_1^n = n \ln n - n + 1} - \underbrace{\frac{1}{2} \int_1^n \frac{\{t\}(1-\{t\})}{t^2} dt}_{:=b_n} \Rightarrow \ln n! = \frac{1}{2} \ln n + n \ln n - n + 1 - b_n.$$

Посмотрим на  $b_n$ :

$$b_n \leq \frac{1}{2} \int_1^n \frac{dt}{t^2} = \frac{1}{2} \left(-\frac{1}{t}\right) \Big|_1^n = \frac{1}{2} \left(1 - \frac{1}{n}\right) < \frac{1}{2} \implies b_n = \underbrace{b}_{=\lim b_n} + o(1).$$

$$\text{А значит } \ln n! = n \ln n - n + \frac{1}{2} \ln n + (1 - b) + o(1).$$

Можем найти  $b$ , для этого представим обе части как экспоненты:  $n! = n^n e^{-n} \sqrt{n} e^{1-b} e^{o(1)} \sim n^n e^{-n} \sqrt{n} C$ .

$$\text{Вспомним (из следствия формулы Валлиса): } \binom{2n}{n} \sim \frac{4^n}{\sqrt{\pi n}}. \text{ А еще знаем, что } \binom{2n}{n} = \frac{(2n)!}{(n!)^2} \sim \frac{(2n)^{2n} e^{-2n} \sqrt{2n} C}{(n^n e^{-n} \sqrt{n} C)^2} = \frac{4^n \sqrt{2}}{\sqrt{n} C}.$$

$$\text{Тогда получаем, что } \frac{4^n}{\sqrt{\pi n}} \sim \frac{4^n \sqrt{2}}{\sqrt{n} C} \implies C \sim \frac{4^n \sqrt{2}}{\sqrt{n}} \cdot \frac{\sqrt{\pi n}}{4^n} = \sqrt{2\pi}.$$

Итоговый результат (Формула Стирлинга):

$$n! \sim n^n e^{-n} \sqrt{2\pi n}$$

$$\ln n! = n \ln n - n + \frac{1}{2} \ln(2\pi n) + o(1).$$

**Замечание.** Если посчитать точнее, то получим  $\ln n! = n \ln n - n + \frac{1}{2} \ln(2\pi n) + \mathcal{O}(\frac{1}{n})$ .

## 1.6. Несобственные интегралы

**Определение 1.20.** Пусть  $-\infty < a < b \leq +\infty$  и  $f \in C[a, b)$ .

Тогда определим  $\int_a^{\rightarrow b} f := \lim_{B \rightarrow b-} \int_a^B f$ .

Если  $-\infty \leq a < b < +\infty$ ,  $f \in C(a, b]$ , тогда  $\int_{\rightarrow a}^b f := \lim_{A \rightarrow a+} \int_A^b f$ .

**Замечание.** Если  $b < +\infty$  и  $f \in C[a, b]$ , то определение не дает ничего нового:

$$\int_a^b f = \lim_{B \rightarrow b} \int_a^B f$$

$$\left| \int_a^b f - \int_a^B f \right| = \left| \int_B^b f \right| \leq M(b - B) \rightarrow 0, M = \max_{x \in [a, b]} f(x).$$

**Пример.** 1.  $\int_1^{+\infty} \frac{dx}{x^p} = \lim_{y \rightarrow +\infty} \int_1^y \frac{dx}{x^p} = \lim_{\substack{y \rightarrow +\infty \\ \text{при } p \neq 1}} -\frac{1}{(p-1)x^{p-1}} \Big|_{x=1}^{x=y} = \frac{1}{p-1} - \lim_{y \rightarrow +\infty} \frac{1}{(p-1)y^{p-1}} = \frac{1}{p-1}$  при  $p > 1$ ,  
при  $p < 1$  получаем  $+\infty$ , а при  $p = 1$   $\lim_{y \rightarrow +\infty} \ln x \Big|_1^y = \lim_{y \rightarrow +\infty} \ln y = +\infty$

2.  $\int_0^1 \frac{dx}{x^p} = \lim_{y \rightarrow 0+} \int_y^1 \frac{dx}{x^p} = \lim_{y \rightarrow 0+} -\frac{1}{(p-1)x^{p-1}} \Big|_{x=y}^{x=1} = -\frac{1}{p-1} + \lim_{y \rightarrow 0+} \frac{y^{1-p}}{p-1} = \frac{1}{1-p}$  при  $p < 1$ , при  $p > 1$   
получаем  $+\infty$ , а вот при  $p = 1$   $\lim_{y \rightarrow 0+} \ln x \Big|_y^1 = \lim_{y \rightarrow 0+} -\ln y = +\infty$ .

То есть, при  $p < 1$   $\int_0^1 \frac{dx}{x^p} = \frac{1}{1-p}$ ,

при  $p \geq 1$   $\int_0^1 \frac{dx}{x^p} = +\infty$ .

**Замечание.** Если  $f \in C[a, b)$  и  $F$  его первообразная, то  $\int_a^b f = \lim_{B \rightarrow b-} F(B) - F(a)$ .

Если  $f \in C(a, b]$  и  $F$  его первообразная, то  $\int_a^b f = F(b) - \lim_{A \rightarrow a+} F(A)$ .

**Доказательство.** Очевидно по формуле Ньютона-Лейбница. □

**Определение 1.21.**  $F \Big|_a^b := \lim_{B \rightarrow b-} F(B) - F(a)$ .

**Определение 1.22.**  $\int_a^{\rightarrow b} f$  сходится, если  $\lim B$  в его определении существует и конечен.

**Теорема 1.23** (Критерий Коши). Пусть  $-\infty < a < b \leq +\infty$ ,  $f \in C[a, b)$ .

Тогда  $\int_a^b f$  сходится  $\iff \forall \varepsilon \exists c \in (a, b): \forall A, B \in (c, b) \left| \int_A^B f \right| < \varepsilon$ .

**Замечание.** 1. Если  $b = +\infty$  это означает, что  $\forall \varepsilon \exists c > a \forall A, B > c: \left| \int_A^B f \right| < \varepsilon$ .

2. Если  $b < +\infty$  это означает, что  $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall A, B \in (b - \delta; b): \left| \int_A^B f \right| < \varepsilon$ .

**Доказательство.** Для  $b < +\infty$ .

- " $\Rightarrow$ "  $\int_a^b f$  сходится  $\Rightarrow \exists$  конечный  $I := \lim_{B \rightarrow b-} \int_a^B f$ , обозначим  $\int_a^B f$  за  $g(B)$ . Воспользуемся критерием Коши для функций:

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \begin{matrix} \forall B \in (b - \delta, b) & |g(B) - I| < \frac{\varepsilon}{2} \\ \forall A \in (b - \delta, b) & |g(A) - I| < \frac{\varepsilon}{2} \end{matrix} \Rightarrow |g(B) - g(A)| \leq |g(B) - I| + |I - g(A)| < \varepsilon$$

- " $\Leftarrow$ "  $\int_a^B f =: g(B)$ .

$\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall A, B \in (b - \delta, b) : |g(B) - g(A)| < \varepsilon$  это условие из критерия Коши для  $\lim_{B \rightarrow b-} g(B)$ .

□

**Замечание.** Если существует  $A_n, B_n \in [a, b) : \lim A_n = \lim B_n = b : \int_{A_n}^{B_n} f \not\rightarrow 0$ , то  $\int_a^b f$  расходится.

**Доказательство.** Возьмем  $A_{n_k}$  и  $B_{n_k} : \left| \int_{A_{n_k}}^{B_{n_k}} f \right| \rightarrow C > 0 \Rightarrow \left| \int_{A_{n_k}}^{B_{n_k}} f \right| > \frac{C}{2}$  при больших  $k$ . Но это противоречит критерию Коши. □

**Свойства несобственных интегралов.** 1. Аддитивность. Пусть  $f \in C[a, b)$ ,  $c \in (a, b)$ .

Если  $\int_a^b f$  сходится, то  $\int_c^b f$  сходится и  $\int_a^b f = \int_a^c f + \int_c^b f$ .

2. Если  $\int_a^b f$  сходится, то  $\lim_{c \rightarrow b-} \int_c^b f = 0$

3. Линейность  $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$  и  $\int_a^b f$  и  $\int_a^b g$  сходятся. Тогда  $\int_a^b (\alpha f + \beta g)$  сходится и  $\int_a^b (\alpha f + \beta g) = \alpha \int_a^b f + \beta \int_a^b g$ .

4. Монотонность. Пусть  $\int_a^b f$  и  $\int_a^b g$  существует в  $\overline{R}$  и  $f \leq g$  на  $[a, b)$ . Тогда  $\int_a^b f \leq \int_a^b g$ .

5. Интегрирование по частям.  $f, g \in C^1[a, b) \Rightarrow \int_a^b f g' = f g \Big|_a^b - \int_a^b f' g$ .

6. Замена переменных.  $\varphi : [\alpha, \beta) \rightarrow [a, b)$ ,  $\varphi \in C^1[\alpha, \beta)$  и  $\exists \lim_{\gamma \rightarrow \beta-} \varphi(\gamma) =: \varphi(\beta-)$  и  $f \in C[a, b)$ .

Тогда  $\int_{\alpha}^{\beta} f(\varphi(t)) \varphi'(t) dt = \int_{\varphi(\alpha)}^{\varphi(\beta-)} f(x) dx$ . «Если существует один из  $\int$ , то существует второй и они равны»

**Доказательство.** 1.  $\int_a^b f = \lim_{B \rightarrow b-} F(B) - F(a) \implies \lim_{B \rightarrow b-} F(B)$  существует и конечный  $\implies \int_c^b f = \lim_{B \rightarrow b-} F(b) - F(c)$  — сходится.

$$\int_a^b f = \lim_{B \rightarrow b-} F(B) - F(a) = \lim_{B \rightarrow b-} F(B) - F(c) + F(c) - F(a) = \int_c^b f + \int_a^c f.$$

$$2. \int_c^b f = \int_c^b f - \int_a^c f \rightarrow \int_a^b f - \int_a^b f = 0$$

$$3. \int_a^b (\alpha f + \beta g) = \lim_{B \rightarrow b-} \int_a^B (\alpha f + \beta g) = \lim_{B \rightarrow b-} (\alpha \int_a^B f + \beta \int_a^B g) = \alpha \lim_{B \rightarrow b-} \int_a^B f + \beta \lim_{B \rightarrow b-} \int_a^B g = \alpha \int_a^b f + \beta \int_a^b g.$$

$$4. \int_a^B f \leq \int_a^B g \text{ (монотонность интеграла), а дальше предельный переход.}$$

$$5. a < B < b. \int_a^B f g' = f g \Big|_a^B - \int_a^B f' g \text{ и переход к пределу. Так как } f, g \text{ — непрерывные функции, то } \lim_{B \rightarrow b-} f g \Big|_a^B = f g \Big|_a^b, \text{ а интеграл по определению.}$$

$$6. F(y) := \int_{\varphi(\alpha)}^y f(x) dx, \Phi(\gamma) := \int_{\alpha}^{\gamma} f(\varphi(t)) \varphi'(t) dt. \text{ Знаем, что } F(\varphi(\gamma)) = \Phi(\gamma) \text{ при } \alpha < \gamma < \beta.$$

Пусть существует правый  $\int$ , то есть  $\exists \lim_{y \rightarrow \varphi(\beta-)} F(y)$ . Возьмем  $\gamma_n \nearrow \beta \implies \varphi(\gamma_n) \rightarrow$

$$\varphi(\beta-) \implies \Phi(\gamma_n) = F(\varphi(\gamma_n)) \rightarrow \int_{\varphi(\alpha)}^{\varphi(\beta-)} f(x) dx. \text{ При этом } \Phi(\gamma_n) \rightarrow \int_{\alpha}^{\beta} f(\varphi(t)) \varphi'(t) dt.$$

Пусть существует левый  $\int$ , то есть  $\exists \lim_{\gamma \rightarrow \beta-} \Phi(\gamma)$ . Докажем, что  $\exists$  правый  $\int$ . При  $\varphi(\beta-) < b$  нечего доказывать.

Пусть  $\varphi(\beta-) = b$ . Тогда возьмем  $b_n \nearrow b$ . Можно считать, что  $b_n \in [\varphi(\alpha), b)$ . Тогда  $\exists \gamma_n \in [\alpha, \beta) : \varphi(\gamma_n) = b_n$ . Докажем, что  $\gamma_n \rightarrow \beta$ . Пусть это не так. Тогда найдется  $\gamma_{n_k} \rightarrow \tilde{\beta} < \beta \implies \varphi(\gamma_{n_k}) \rightarrow \varphi(\tilde{\beta}) < b$  по непрерывности в  $\tilde{\beta}$ . Противоречие.

$$\text{Итак, } \gamma_n \rightarrow \beta, F(b_n) = F(\varphi(\gamma_n)) = \Phi(\gamma_n) \rightarrow \int_{\alpha}^{\beta} f(\varphi(t)) \varphi'(t) dt.$$

□

**Замечание ко второму свойству.** 1. Если  $\int_a^b f$  сходится, а  $\int_a^b g$  расходится, то  $\int_a^b (f+g)$  расходится. Доказательство от противного, пусть интеграл сходится, то  $g = (f+g) - f \implies \int_a^b g$  сходится.

$$2. \text{ Если } \int_a^b f \text{ и } \int_a^b g \text{ расходятся, то } \int_a^b (f+g) \text{ может сходиться. } \int_1^{+\infty} \frac{dx}{x} \text{ и } \int_1^{+\infty} -\frac{dx}{x} \text{ расходятся.}$$

**Замечание к шестому свойству.**  $\int_a^b f(x) dx$ . Сделаем замену  $x = b - \frac{1}{t} = \varphi(t)$ ,  $\varphi'(t) = \frac{1}{t^2}$ ,  $\varphi(\alpha) = a$ ,  $\alpha = \frac{1}{b-a}$ .

$$\text{Тогда } \int_a^b f(x)dx = \int_{\frac{1}{b-a}}^{+\infty} f(b - \frac{1}{t}) \frac{1}{t^2} dt.$$

**Определение 1.23.** Пусть  $f$  непрерывен на  $(a, b)$  за исключением точек  $c_1 < c_2 < \dots < c_n$ .

$\int_a^b f$  сходится, если сходятся интегралы по все маленьким отрезкам (содержащих только одну выколотую точку).

## Несобственные интегралы от неотрицательных функций

**Теорема 1.24.** Пусть  $f \in C[a, b)$  и  $f \geq 0$ .

$$\text{Тогда } \int_a^b f \text{ сходится} \iff F(y) := \int_a^y f \text{ ограничена сверху.}$$

**Доказательство.**  $f \geq 0 \implies F$  монотонно возрастает.  $\int_a^b f$  сходится  $\iff \exists$  конечный  $\lim_{y \rightarrow b-} F(y) \iff F$  ограничена сверху. □

**Замечание.**  $f \in C[a, b), f \geq 0$ .  $\int_a^b f$  расходящийся означает, что  $\int_a^b f = +\infty$ .

**Следствие Признак сравнения.**  $f, h \in C[a, b), f, g \geq 0$  и  $f \leq g$ .

1. Если  $\int_a^b g$  сходится, то  $\int_a^b f$  сходится.
2. Если  $\int_a^b f$  расходится, то  $\int_a^b g$  расходится.

**Доказательство.**  $F(y) := \int_a^y f$  и  $G(y) := \int_a^y g$ .

1. Пусть  $\int_a^b g$  сходящийся  $\implies G(y)$  ограничена, но  $F(y) \leq G(y) \implies F(y)$  ограничена  $\implies \int_a^b f$  сходящаяся.
2. От противного.

□

**Замечание.** 1. Неравенство  $f \leq g$  нужно лишь для аргументов близких к  $b$ .

2. Неравенство  $f \leq g$  можно заменить на  $f = \mathcal{O}(g)$ .

$$f = \mathcal{O}(g) \implies f \leq cg. \int_a^b g \text{ сходящийся} \implies \int_a^b cg \text{ сходящийся} \implies \int_a^b f - \text{сходящийся.}$$

3. Если  $f = \mathcal{O}(\frac{1}{x^{1+\varepsilon}})$  для  $\varepsilon > 0$ , то  $\int_a^{+\infty} f$  — сходящийся.

$$g(x) = \frac{1}{x^{1+\varepsilon}} \text{ и можно считать, что } a \geq 1 \int_a^{+\infty} g(x)dx - \text{сходящийся.}$$

**Следствие.**  $f, g \in C[a, b)$ ,  $f, g \geq 0$  и  $f(x) \sim g(x), x \rightarrow b-$ . Тогда  $\int_a^b f$  и  $\int_a^b g$  ведут себя одинаково (либо оба сходятся, либо оба расходятся).

**Доказательство.**  $f \sim g \implies f = \varphi \cdot g$ , где  $\varphi(x) \xrightarrow{x \rightarrow b-} 1 \implies$  в окрестности  $b$   $\frac{1}{2} \leq \varphi \leq 2 \implies f \leq 2g \wedge g \leq 2f$  в окрестности  $b \implies$  из сходимости интеграла  $g$  следует сходимость  $f \wedge$  наоборот.  $\square$

**Определение 1.24.**  $f \in C[a, b)$ .  $\int_a^b f$  абсолютно сходится, если  $\int_a^b |f|$  сходится.

**Теорема 1.25.**  $\int_a^b f$  сходится абсолютно  $\implies \int_a^b f$  сходится.

**Доказательство.**  $f = f_+ - f_-$ ,  $|f| = f_+ + f_-$ .  $|f| \geq f_{\pm} \geq 0$ . Если  $\int_a^b f$  сходится абсолютно  $\implies \int_a^b$  сходится  $\int_a^b f_{\pm}$  сходится  $\implies \int_a^b f = \int_a^b f_+ - \int_a^b f_-$  сходящийся.  $\square$

**Теорема 1.26** (Признак Дирихле).  $f, g \in C[a, +\infty)$ . Если

1.  $f$  имеет ограниченную на  $[a, +\infty]$  первообразную, то есть  $\left| \int_a^y f(x) dx \right| \leq K \quad \forall y$ .
2.  $g$  монотонна.
3.  $\lim_{x \rightarrow +\infty} g(x) = 0$

, то  $\int_a^{+\infty} f(x)g(x)dx$  сходится.

**Доказательство.** Только для случая  $g \in C^1[a; +\infty)$ .

Надо доказать, что  $\exists$  конечный  $\lim_{y \rightarrow +\infty} \int_a^y f(x)g(x)dx$ ,  $F(y) := \int_a^y f(x)dx$ .

$$\int_a^y f(x)g(x)dx = \int_a^y F'(x)g(x)dx = F(x)g(x) \Big|_a^y - \int_a^y F(x)g'(x)dx = F(y)g(y) - \int_a^y F(x)g'(x)dx$$

Чтобы доказать существование предела у разности каких-то штук, нужно доказать, что он существует у них по отдельности.

$\lim_{y \rightarrow +\infty} F(y)g(y) = 0$  — произведение бесконечно малой и ограниченной функции.

Хотим показать, что  $\int_a^y F(x)g'(x)dx$  имеет конечный  $\lim$ , то есть  $\int_a^{+\infty} F(x)g'(x)dx$  сходится.

Тогда докажем, что он абсолютно сходится.  $\int_a^{+\infty} |F(x)||g'(x)|dx$ ,  $|F(x)||g'(x)| \leq K|g'(x)| = K|g'(x)|$ . (считаем, что  $g(x)$  возрастает)  $\int_a^{+\infty} g'(x)dx = g \Big|_a^{+\infty} = \lim_{y \rightarrow +\infty} g(y) - g(a) = -g(a) \implies$  сходящийся.  $\square$

**Теорема 1.27** (Признак Абеля).  $f, g \in C[a, +\infty]$ , Если

1.  $\int_a^{+\infty} f(x)dx$  сходится,
2.  $g$  монотонна,
3.  $g$  ограничена

Тогда  $\int_a^{+\infty} f(x)g(x)dx$  сходится.

**Доказательство.** 2) + 3)  $\implies \exists l \in \mathbb{R} := \lim_{x \rightarrow +\infty} g(x)$ .

Пусть  $\tilde{g}(x) := g(x) - l \implies \lim_{x \rightarrow +\infty} \tilde{g}(x) = 0$  и  $\tilde{g}$  монотонна.

Пусть  $F(x) := \int_a^x f(t)dt$ . 1)  $\iff$  существует конечный предел  $\lim_{x \rightarrow +\infty} F(x)$ .

Тогда  $f$  и  $\tilde{g}$  удовлетворяют условиям признака Дирихле  $\implies \int_a^{+\infty} f(x)\tilde{g}(x)dx$  — сходится.

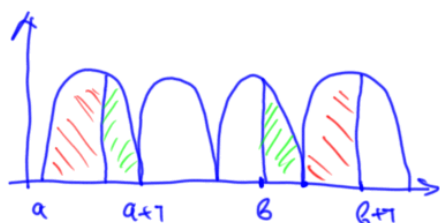
Тогда:

$$\int_a^{+\infty} f(x)g(x)dx = \int_a^{+\infty} f(x)(\tilde{g}(x) + l)dx = \int_a^{+\infty} f(x)\tilde{g}(x)dx + l \int_a^{+\infty} f(x)dx.$$

Где  $\int_a^{+\infty} f(x)\tilde{g}(x)dx$  сходится по доказанному, а  $\int_a^{+\infty} f(x)dx$  — по условию. □

**Утверждение 1.28.**  $f$  — периодическая функция с периодом  $T$ . Тогда  $\int_a^{a+T} f = \int_b^{b+T} f$

**Доказательство.** Картинка:



$$\begin{aligned} \int_b^{a+T} f &= \int_{b-(k-1)T}^{a+T} f \\ \int_b^{b+T} f &= \int_a^{a+T} f \end{aligned}$$

□

**Следствие.**  $f, g \in C[a; +\infty)$ ,  $f$  — периодическая с периодом  $T$ ,  $g$  монотонная и  $g \xrightarrow{x \rightarrow +\infty} 0$ . Тогда  $\int_a^{+\infty} g(x)dx$  расходится.

Тогда  $\int_a^{+\infty} fg$  сходится  $\iff \int_a^{a+T} f = 0$ .

**Доказательство.**  $\Leftarrow$ .  $F(x) = \int_a^x f$  — периодична с периодом  $T$ :  $F(x+T) = \int_a^{x+T} f = \int_a^x f + \int_x^{x+T} f = F(x) + \int_a^{a+T} f$ .  $F(x)$  — непрерывна и периодична  $\implies$  ограничена  $\implies \int_a^{+\infty} fg$  сходится по признаку Дирихле.



$\Rightarrow$ . Пусть  $\int_a^{a+T} f =: K \neq 0$ .  $\tilde{f}(x) =: f(x) - \frac{K}{T}$  — периодична с периодом  $T$ . Тогда  $\int_a^{a+T} \tilde{f} = \int_a^{a+T} (f - \frac{K}{T}) = K - T \cdot \frac{K}{T} = 0 \Rightarrow \int_a^{+\infty} \tilde{f}g$  сходится.

Тогда  $\int_a^{+\infty} fg = \int_a^{+\infty} (\tilde{f} + \frac{K}{T})g = \int_a^{+\infty} \tilde{f}g + \frac{K}{T} \int_a^{+\infty} g \Rightarrow \int_a^{+\infty} fg$  расходится как сумма сходящегося и расходящегося.  $\square$

**Пример.** Рассмотрим  $\int_a^{+\infty} \frac{\sin x}{x^p} dx$ .

1.  $p > 1$  интеграл сходится абсолютно:  $|\sin x| \leq 1 \Rightarrow \left| \frac{\sin x}{x^p} \right| \leq \frac{1}{x^p}$ , а значит  $\int_a^{+\infty} \frac{dx}{x^p}$  сходящийся.

2.  $0 < p \leq 1$  интеграл сходящийся, но не абсолютно.  $\int_a^{+\infty} \frac{dx}{x^p}$  — расходится,  $\frac{1}{x^p} \searrow 0$ .  $g(x) :=$

$$\frac{1}{x^p}, f(x) = \sin x. \int_0^{2\pi} \sin x dx = 0 \Rightarrow \int_1^{+\infty} \frac{\sin x}{x^p} dx \text{ сходящийся.}$$

Если взять  $f(x) = |\sin x|$ , то интеграл по периоду равен 4. Значит исходный интеграл расходится.

3.  $p \leq 0$  интеграл расходится.

$$a_n := \frac{\pi}{6} + 2\pi n, b_n := \frac{5\pi}{6} + 2\pi n. \text{ Тогда } \int_{a_n}^{b_n} \frac{\sin x}{x^p} dx \geq \frac{1}{2} \int_{a_n}^{b_n} \frac{dx}{x^p} \geq \frac{1}{2} \int_{a_n}^{b_n} = \frac{b_n - a_n}{2} = \frac{\pi}{3}.$$

(предъявили сколь угодно далеко такие отрезки, что интеграл по ним превосходит  $\frac{\pi}{3}$  — это отрицание критерия Коши)

## 2. Анализ в метрических пространствах

### 2.1. Метрические и нормированные пространства

**Определение 2.1.** Метрика (расстояние)  $\rho: X \times X \rightarrow [0; +\infty)$ , если выполняются следующие условия:

1.  $\rho(x, y) = 0 \iff x = y$ ,
2.  $\rho(x, y) = \rho(y, x)$ ,
3. (неравенство треугольника)  $\rho(x, z) \leq \rho(x, y) + \rho(y, z)$ .

**Определение 2.2.** Метрическое пространство — пара  $(X, \rho)$ .

**Пример.** Дискретная метрика (метрика Лентяя)  $\rho(x, y) = \begin{cases} 0, & x = y \\ 1 & x \neq y \end{cases}$

**Пример.** На  $\mathbb{R}$ :  $\rho(x, y) = |x - y|$ .

**Пример.** На  $\mathbb{R}^d$ :  $\rho(x, y) = \sqrt{\sum_{k=1}^d (x_k - y_k)^2}$ . Неравенство треугольника здесь — неравенство Минковского.

**Пример.**  $C[a, b]$ .  $\rho(f, g) = \int_a^b |f - g|$ .

Неравенство треугольника:

$$\rho(f, h) = \int_a^b |f - h| \stackrel{(*)}{\leq} \int_a^b (|f - g| + |g - h|) = \rho(f, g) + \rho(g, h).$$

(\*)  $\iff |f(x) - h(x)| \leq |f(x) - g(x)| + |g(x) - h(x)|$  — неравенство треугольника для  $(\mathbb{R}, |x - y|)$ .

**Пример.** Манхэттенская метрика:  $\mathbb{R}^2$ ,  $\rho((x_1, y_1), (x_2, y_2)) = |x_1 - x_2| + |y_1 - y_2|$ .

**Пример.** Французская железнодорожная метрика.  $\mathbb{R}^2$ . Есть точка  $P$  (Париж), тогда  $\rho(A, B) = AB$ , если  $A, B, P$  на одной прямой, иначе  $\rho(A, B) = |AP| + |PB|$ .

**Определение 2.3.**  $(X, \rho)$  — метрическое пространство.  $B_r(x) := \{y \in X \mid \rho(x, y) < r\}$  — открытый шар радиуса  $r$  с центром в точке  $x$ .

**Определение 2.4.**  $(X, \rho)$  — метрическое пространство.  $\overline{B}_r(x) := \{y \in X \mid \rho(x, y) \leq r\}$  — закрытый шар радиуса  $r$  с центром в точке  $x$ .

**Свойства.** 1.  $B_{r_1}(a) \cap B_{r_2}(a) = B_{\min\{r_1, r_2\}}(a)$ .

2.  $x \neq y \implies \exists r > 0: B_r(x) \cap B_r(y) = \emptyset \wedge \overline{B}_r(x) \cap \overline{B}_r(y) = \emptyset$ .

**Доказательство.** 1.  $x \in B_{r_1}(a) \cap B_{r_2}(a) \iff \begin{cases} \rho(x, a) < r_1 \\ \rho(x, a) < r_2 \end{cases} \iff \rho(x, a) < \min\{r_1, r_2\} \implies x \in B_{\min\{r_1, r_2\}}(a)$ .

2.  $r := \frac{1}{3}\rho(x, y) > 0$ . Пусть  $\overline{B}_r(x) \cap \overline{B}_r(y) \neq \emptyset$ .

Тогда  $\exists z \in \overline{B}_r(x) \cap \overline{B}_r(y) \implies \rho(x, z) \leq r \wedge \rho(y, z) \leq r \implies \rho(x, y) \leq \rho(x, z) + \rho(z, y) \leq 2r = \frac{2}{3}\rho(x, y) \implies 1 \leq \frac{2}{3}$ . Противоречие.

При этом,  $B_r(x) \subset \overline{B}_r(x) \implies \exists r: B_r(x) \cap B_r(y) = \emptyset$ .

□

**Определение 2.5.**  $A \subset X$ .  $A$  — открытое множество, если  $\forall a \in A \exists B_r(a) \subset A$  ( $r > 0$ ).

**Теорема 2.1** (О свойствах открытых множеств). 1.  $\emptyset, X$  — открытые.

2. Объединение любого числа открытых множеств — открытое.

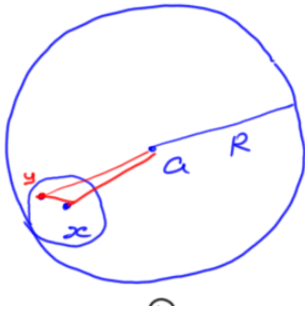
3. Пересечение конечного числа открытых множеств — открытое.

4.  $B_r(a)$  — открытое.

**Доказательство.** 2.  $A_\alpha$  — открытые,  $\alpha \in I$ .  $B := \bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha$ . Берем  $b \in B \implies b \in A_\beta$  для некоторого  $\beta$ . Но  $A_\beta$  — открытое  $\implies \exists r > 0$   $B_r(b) \subset A_\beta \subset B$ .

3.  $A_1, A_2, \dots, A_n$  — открытые.  $B := \bigcap_{k=1}^n A_k$ . Берем  $b \in B \implies b \in A_k \forall k = 1, 2, \dots, n$ . Но  $A_k$  — открытое  $\implies \exists r_k > 0$   $B_{r_k} \subset A_k$ .  $\forall k$   $B_{r_k}(b) \subset \bigcap_{k=1}^n A_k = B \implies \exists r = \min_{i=1..n} r_i: B_r(b) \subset B \forall b \in B \implies B$  — открытое.

4.  $\rho(a, x) < R$ ,  $r := R - \rho(a, x) > 0$ . Докажем, что  $B_r(x) \subset B_R(a)$ . Возьмем  $y \in B_r(x)$ , то есть  $\rho(x, y) < r \implies \rho(y, a) \leq \rho(y, x) + \rho(x, a) < r + \rho(x, a) = R \implies y \in B_R(a)$ .



□

**Замечание.** Существенна конечность.  $\mathbb{R}. \bigcap_{n=1}^{\infty} (-\frac{1}{n}, 1) = [0, 1)$ . А для нуля любой открытый шарик плохой.

**Определение 2.6.**  $A \subset X$ ,  $a \in A$ .  $a$  — внутренняя точка множества  $A$ , если  $\exists r > 0: B_r(a) \subset A$ .

**Замечание.**  $A$  — открытое  $\iff$  все его точки внутренние.

**Определение 2.7.** Внутренность множества  $\text{Int } A := \{a \in A \mid a \text{ — внутренняя точка}\}$ .

**Пример.**  $A = [0, 1] \subset \mathbb{R}$ . Тогда  $\text{Int } A = (0, 1)$ .

**Свойства внутренности.** 1.  $\text{Int } A \subset A$ .

2.  $\text{Int } A = \bigcup$  всех открытых множеств, которые содержатся в  $A$ .

3.  $\text{Int } A$  — открытое множество.
4.  $A$  — открытое  $\iff A = \text{Int } A$ .
5. Если  $A \subset B$ , то  $\text{Int } A \subset \text{Int } B$ .
6.  $\text{Int}(A \cap B) = \text{Int } A \cap \text{Int } B$
7.  $\text{Int}(\text{Int } A) = \text{Int } A$ .

**Доказательство.**

2.  $B := \bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha$ ,  $A_\alpha \subset A$ ,  $A_\alpha$  открытые.  
 $B \subset \text{Int } A$ . Берем  $b \in B \implies \exists \beta \in I: b \in A_\beta$  — открытое  $\implies \exists r > 0: B_r(b) \subset A_\beta \subset A \implies b$  — внутренняя точка  $A \implies b \in \text{Int } A$ .  
 $\text{Int } A \subset B$ . Берем  $b \in \text{Int } A \implies \exists r > 0 B_r(b) \subset A$ , но  $B_r(b)$  — открытое множество  $\implies$  оно участвует в объединении  $\bigcup_{\alpha} A_\alpha \implies B_r(b) \subset B \implies b \in B$ .
4.  $\Leftarrow$ : пользуемся пунктом 3.  
 $\Rightarrow$ : всего его точки внутренние  $\implies A = \text{Int } A$ .
6.  $\subset$ :  $A \cap B \subset A, \subset B \implies \text{Int}(A \cap B) \subset \text{Int } A \wedge \text{Int}(A \cap B) \subset \text{Int } B$ .  
 $\supset$ . Пусть  $x \in \text{Int } A \cap \text{Int } B \implies \begin{cases} \exists r_1 > 0 & B_{r_1}(x) \subset A \\ \exists r_2 > 0 & B_{r_2}(x) \subset B \end{cases} \implies \text{если } r = \min\{r_1, r_2\} \implies B_r(x) \subset A \wedge B_r(x) \subset B \implies B_r(x) \subset A \cap B \implies x \in \text{Int}(A \cap B)$ .
7.  $B := \text{Int } A$  — открытое  $\implies B = \text{Int } B$ .

□

**Определение 2.8.**  $A \subset X$ .  $A$  — замкнутое, если  $X \setminus A$  — открытое.

**Теорема 2.2** (о свойствах замкнутых множеств). 1.  $\emptyset, X$  — замкнуты.

2. Пересечение любого числа замкнутых множеств — замкнуто.
3. Объединение конечного числа замкнутых множеств — замкнуто.
4.  $\overline{B}_R(a)$  — замкнуто.

**Доказательство.** 2.  $A_\alpha$  — замкнуты  $\implies X \setminus A_\alpha$  — открытые  $\implies \bigcup_{\alpha \in I} X \setminus A_\alpha$  — открыто  $\implies X \setminus \bigcup_{\alpha \in I} (X \setminus A_\alpha) = \bigcap_{\alpha \in I} A_\alpha$  — замкнутое.

4.  $X \setminus \overline{B}_R(a)$  — открытое. Берем  $x \notin \overline{B}_R(a)$ . Возьмем  $r := \rho(a, x) - R > 0$ . Покажем, что  $B_r(x) \subset X \setminus \overline{B}_R(a)$ .

От противного. Пусть  $B_r(x) \cap \overline{B}_R(a) \neq \emptyset$ . Берем  $y \in B_r(x) \cap \overline{B}_R(a) \implies \rho(x, y) < r \wedge \rho(a, y) \leq R \implies \rho(a, x) \leq \rho(a, y) + \rho(y, x) < R + r = \rho(a, x)$ . Противоречие.

□

**Замечание.** В 3 важна конечность.  $\mathbb{R}. \bigcup_{n=1}^{\infty} [\frac{1}{n}, 1] = (0, 1]$  — не является замкнутой.

**Определение 2.9.** Замыкание множества  $\text{Cl } A$  — пересечение всех замкнутых множеств, содержащих  $A$ .

**Теорема 2.3.**  $X \setminus \text{Cl } A = \text{Int}(X \setminus A)$  и  $X \setminus \text{Int } A = \text{Cl}(X \setminus A)$ .

**Доказательство.**  $\text{Int}(X \setminus A) = \bigcup B_\alpha$ .  $B_\alpha$  — открытые,  $B_\alpha \subset X \setminus A \iff X \setminus B_\alpha$  — замкнутое.  $X \setminus B_\alpha \supset A$ .

$$\bigcap (X \setminus B_\alpha) = \text{Cl } A \implies X \setminus \bigcap (X \setminus B_\alpha) = X \setminus \text{Cl } A \iff \bigcup (B_\alpha) = \text{Int}(X \setminus A). \quad \square$$

**Следствие.**  $\text{Int } A = X \setminus \text{Cl}(X \setminus A)$  и  $\text{Cl } A = X \setminus \text{Int}(X \setminus A)$ .

**Свойства.** 1.  $\text{Cl } A \supset A$ .

2.  $\text{Cl } A$  — замкнутое множество.

3.  $A$  — замкнуто  $\iff A = \text{Cl } A$ .

**Доказательство.**  $\Leftarrow$  — пункт 2.  $\Rightarrow A$  — замкнутое  $\Rightarrow$  оно участвует в пересечении из определения  $\implies \text{Cl } A \subset A \implies \text{Cl } A = A$ .  $\square$

4.  $A \subset B \implies \text{Cl } A \subset \text{Cl } B$ .

**Доказательство.**  $X \setminus A \supset X \setminus B \implies \text{Int}(X \setminus A) \supset \text{Int}(X \setminus B) \implies X \setminus \text{Int}(X \setminus A) \subset X \setminus \text{Int}(X \setminus B)$   $\square$

5.  $\text{Cl}(A \cup B) = \text{Cl } A \cup \text{Cl } B$ .

6.  $\text{Cl}(\text{Cl } A) = \text{Cl } A$ .

**Доказательство.**  $B := \text{Cl } A$  — замкнуто  $\implies \text{Cl } B = B$ .  $\square$

**Упражнение.**  $\text{Cl } \text{Int } \text{Cl } \text{Int} \dots A$ . Какое наибольшее количество различных множеств может получиться.

**Теорема 2.4.**  $x \in \text{Cl } A \iff \forall r > 0 \quad B_r(x) \cap A \neq \emptyset$ .

**Доказательство.** Запишем отрицание условия теоремы:  $x \notin \text{Cl } A \iff \exists r > 0 \quad B_r(x) \cap A = \emptyset$ .

Что означает, что  $x \notin A$ ? Это значит, что  $x \in X \setminus \text{Cl } A = \text{Int}(X \setminus A) \iff x \in \text{Int}(X \setminus A) \iff x$  — внутренняя точка  $X \setminus A \iff \exists r > 0: B_r(x) \cap A = \emptyset \iff \exists r > 0: B_r(x) \subset X \setminus A$ .  $\square$

**Следствие.**  $U$  — открытое,  $U \cap A = \emptyset \implies U \cap \text{Cl } A = \emptyset$ .

**Доказательство.** Возьмем  $x \in U \implies \exists r > 0: B_r(x) \subset U \implies B_r(x) \cap A = \emptyset \implies x \notin \text{Cl } A \implies U \cap \text{Cl } A = \emptyset$ .  $\square$

**Определение 2.10.** Окрестностью точки  $x$  будем называть шар  $B_r(x)$  для некоторого  $r > 0$ . Обозначать будем  $U_x$ .

**Определение 2.11.** Проколотой окрестностью точки  $x$  —  $B_r(x) \setminus \{x\}$ . Обозначать будем  $\dot{U}_x$ .

**Определение 2.12.**  $x$  — предельная точка множества  $A$ , если  $\forall \dot{U}_x: \dot{U}_x \cap A \neq \emptyset$ .

Обозначим через  $A'$  — множество предельных точек для  $A$ .

**Свойства.**

1.  $\text{Cl } A = A \cup A'$ .

**Доказательство.**  $x \in \text{Cl } A \iff \forall U_x: U_x \cap A \neq \emptyset \iff \begin{cases} x \in A \\ \forall \dot{U}_x \cap A \neq \emptyset \iff x \in A' \end{cases} \quad \square$

2.  $A \subset B \implies A' \subset B'$ . Очевидно.

3.  $A$  — замкнуто  $\iff A \supset A'$ .

**Доказательство.**  $A$  — замкнуто  $\iff A = \text{Cl } A \iff A = A \cup A' \iff A \supset A'$ .  $\square$

4.  $(A \cup B)' = A' \cup B'$ .

**Доказательство.** Докажем " $\Leftarrow$ ". Возьмем  $x \in (A \cup B)'$ :  $x \notin A' \implies \exists \dot{U}_x: \dot{U}_x \cap A = \emptyset$ , но  $\dot{U}_x \cap (A \cup B) \neq \emptyset \implies \dot{U}_x \cap B \neq \emptyset \implies x \in B'$ .

Докажем " $\Rightarrow$ ".  $A \cup B \supset A \implies (A \cup B)' \supset A'$ . Проверим тот же фокус для  $B$ , получим  $(A \cup B)' \supset A' \cup B'$ .  $\square$

**Теорема 2.5.**  $x \in A' \iff \forall r > 0 \ B_r(x)$  содержит бесконечное количество точек из  $A$ .

**Доказательство.** Докажем " $\Leftarrow$ ".  $B_r(x) \cap A$  содержит бесконечное количество точек  $\implies \dot{B}_r(x) \cap A$  содержит бесконечное число точек  $\implies \dot{B}_r(x) \cap A \neq \emptyset \implies x \in A'$ .

" $\Rightarrow$ ". Возьмем радиус  $r$ . Тогда  $\dot{B}_r(x) \cap A \neq \emptyset \implies \exists x_1 \in A: 0 < \rho(x, x_1) < r$ . Возьмем  $r = \rho(x, x_1)$ .  $\dot{B}_r(x) \cap A \neq \emptyset \implies \exists x_2 \in A: 0 < \rho(x, x_2) < \rho(x, x_1)$ . Тогда можно взять  $r = \rho(x, x_2)$ , и так далее.

В итоге получили, что  $r > \rho(x, x_1) > \rho(x, x_2) > \rho(x, x_3) > \dots > 0 \implies$  все  $x_n$  различны.  $\square$

**Следствие.** Конечное множество не имеет предельных точек.

**Доказательство.** Предположим конечная точка существует  $\iff \exists r > 0: B_r(x) \cap A$  содержит бесконечное количество точек. Но это невозможно, так как в  $A$  конечное число точек.  $\square$

**Определение 2.13.**  $(X, \rho)$  — метрическое пространство  $Y \subset X$ .

Тогда  $(Y, \rho|_{Y \times Y})$  — подпространство метрического пространства  $(X, \rho)$ .

**Пример.**  $(\mathbb{R}, |x - y|)$ .  $Y = [a, b] \subset \mathbb{R}$ .

$$B_1(1) = (0, 1], B_2(0) = [0, 1]. \ B_r^Y(a) = Y \cap B_r^X(a).$$

**Теорема 2.6** (об открытых и замкнутых множества в пространстве и подпространстве).  $(X, \rho)$  — метрическое пространство,  $(Y, \rho)$  — его подпространство,  $A \subset Y$ . Тогда

1.  $A$  — открыто в  $Y \iff \exists G$  — открытое в  $X: A = G \cap Y$ .

2.  $A$  — замкнуто в  $Y \iff \exists F$  — замкнутое в  $X: A = F \cap Y$ .

**Доказательство.**

1. " $\Rightarrow$ ".  $A$  — открыто в  $Y \implies \forall x \in A \exists r_x > 0: B_{r_x}^Y(x) \subset A \implies A = \bigcup_{x \in A} B_{r_x}^Y(x)$ .

То есть наше множество будет объединением большего числа шариков (возможно бесконечного). Найдем теперь  $G$ :  $G := \bigcup_{x \in A} B_{r_x}^X(x)$  — открыто. Посмотрим теперь на  $G \cap Y =$

$$\bigcup_{x \in A} (B_{r_x}^X(x) \cap Y) = \bigcup_{x \in A} B_{r_x}^Y(x) = A.$$

В обратную сторону. Пусть  $A = G \cap Y$ , где  $G$  открыто в  $X$ . Возьмем  $x \in G \cap Y$ .  $G$  — открыто в  $X \implies \forall x \in G \cap Y \exists r > 0: B_r^X(x) \subset G \implies B_r^X(x) \cap Y \subset G \cap Y = A \implies B_r^Y(x) \subset A \implies x$  — внутренняя точка  $A \implies A$  — открыто в  $Y$ .

2.  $A$  — замкнуто в  $Y \iff Y \setminus A$  — открыто в  $Y \iff \exists G$  — открытое в  $X$ , такое что  $Y \setminus A = Y \cap G \iff A = Y \setminus (Y \cap G) \stackrel{(1)}{=} Y \setminus G \stackrel{(2)}{=} Y \cap (X \setminus G) \iff \exists G$  — открытое в  $X$ , такое что  $A = Y \cap (X \setminus G) \iff \exists F$  — замкнуто в  $X$ , такое что  $A = Y \cap F$ .

(1) — Можно забыть на пересечение с  $Y$ , потому что, если элемент  $G$  не лежит в  $Y$ , то и в  $Y \setminus G$  он участия не принимает. (2) — Помним, что  $Y \subset X$ , а значит такая операция корректна.

□

**Пример.**  $(\mathbb{R}, |x-y|)$ .  $Y = [0, 3]$ .  $[0, 1]$  — открыто в  $[0, 3]$ :  $[0, 1] = [0, 3] \cap (-1, -1)$ .  $[2, 3]$  — замкнуто в  $[0, 3]$ :  $[2, 3] = [0, 3] \cap [2, 3]$ .

**Определение 2.14.**  $X$  — векторное пространство над  $\mathbb{R}$ .

$\|\cdot\|: X \rightarrow \mathbb{R}$  — норма, если

$$1. \|x\| \geq 0 \quad \forall x \in X \text{ и } \|x\| = 0 \iff x = \vec{0}.$$

$$2. \|\lambda x\| = |\lambda| \cdot \|x\| \quad \forall x \in X \quad \forall \lambda \in \mathbb{R}.$$

3. (неравенство треугольник)

**Пример.** 1.  $|x| \in \mathbb{R}$ ,

$$2. \|x\|_1 = |x_1| + |x_2| + \dots + |x_d| \text{ в } \mathbb{R}^d.$$

$$3. \|x\|_\infty = \max_{k=1,2,\dots,d} |x_k|. \|x+y\|_\infty = \max\{|x_k| + |y_k|\} \leq \max\{|x_k|\} + \max\{|y_k|\} = \|x\|_\infty + \|y\|_\infty$$

$$4. \|x\|_2 = \sqrt{x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_n^2}.$$

$$5. \|x\|_p = \left( \sum_{k=1}^d |x_k|^p \right)^{\frac{1}{p}} \text{ в } \mathbb{R}^d \text{ при } p \geq 1. \text{ Неравенство треугольника — неравенство Минковского.}$$

$$6. C[a, b]. \|f\| = \max_{t \in [a, b]} |f(t)|.$$

**Определение 2.15.**  $X$  векторное пространство над  $\mathbb{R}$ .  $\langle \cdot, \cdot \rangle: X \times X \rightarrow \mathbb{R}$  скалярное произведение, если

$$1. \langle x, x \rangle \geq 0 \text{ и } \langle x, x \rangle = 0 \iff x = \vec{0}.$$

$$2. \langle x+y, z \rangle = \langle x, z \rangle + \langle y, z \rangle$$

$$3. \langle x, y \rangle = \langle y, x \rangle.$$

$$4. \langle \lambda x, y \rangle = \lambda \langle x, y \rangle \quad \lambda \in \mathbb{R}.$$

**Пример.** 1.  $\mathbb{R}^d$ .  $\langle x, y \rangle = \sum x_i y_i$ .

$$2. \text{ Возьмем } w_1, \dots, w_d > 0. \text{ Тогда } \langle x, y \rangle = \sum w_i x_i y_i.$$

$$3. C[a, b]. \langle f, g \rangle = \int_a^b f(x)g(x)dx.$$

**Свойства.** 1. Неравенство Коши-Буняковского.  $\langle x, y \rangle^2 \leq \langle x, x \rangle \cdot \langle y, y \rangle$ .

**Доказательство.**  $f(t) := \langle x + ty, x + ty \rangle \geq 0$ .  $f(t) = \langle x, x \rangle + 2t\langle x, y \rangle + t^2\langle y, y \rangle = t^2\langle y, y \rangle + 2t\langle x, y \rangle + \langle x, x \rangle$  — квадратный трехчлен (если  $\langle y, y \rangle = 0 \implies y = 0 \implies$  везде нули). Тогда  $0 \geq D = (\langle x, y \rangle)^2 - 4\langle x, x \rangle \cdot \langle y, y \rangle = 4(\langle x, y \rangle^2 - \langle x, x \rangle \cdot \langle y, y \rangle)$ . Потому что иначе есть значения меньше нуля.  $\square$

2.  $\|x\| := \sqrt{\langle x, x \rangle}$  — норма.

**Доказательство.**  $\|\lambda x\| = \sqrt{\langle \lambda x, \lambda x \rangle} = \sqrt{\lambda^2 \langle x, x \rangle} = |\lambda| \sqrt{\langle x, x \rangle} = |\lambda| \cdot \|x\|$ .

Неравенство треугольника:  $\|x + y\| \leq \|x\| + \|y\|$ . Возведем в квадрат, получим  $\langle x + y, x + y \rangle \leq \langle x, x \rangle + \langle y, y \rangle + 2\sqrt{\langle x, x \rangle \langle y, y \rangle}$ , но теперь вспомним, что  $\langle x + y, x + y \rangle = \langle x, x \rangle + \langle y, y \rangle + 2\langle x, y \rangle$ . А, сократив общие слагаемые, получим доказанное неравенство Коши-Буняковского.  $\square$

3.  $\rho(x, y) = \|x - y\|$  — метрика.

**Доказательство.**  $\rho(x, y) \geq 0$ .  $\rho(x, y) = 0 \iff \|x - y\| = 0 \iff x - y = \vec{0} \iff x = y$ .

$\rho(y, x) = \|y - x\| = \|(-1)(x - y)\| = |-1| \|x - y\| = \rho(x, y)$ .

$\rho(x, z) \leq \rho(x, y) + \rho(y, z)$ :  $\|(x - y) + (y - z)\| = \|x - z\| \leq \|x - y\| + \|y - z\|$ .  $\square$

4.  $\|x - y\| \geq |\|x\| - \|y\||$ .

**Доказательство.** Надо доказать, что  $-\|x - y\| \leq \|x\| - \|y\| \leq \|x - y\|$ .

$\|(y - x) + x\| = \|y\| \leq \|x\| + \|x - y\| = \|x\| + \|y - x\|$ .  $\square$

5. Упражнение. Если норма порождается скалярным произведением  $\iff \|x + y\|^2 + \|x - y\|^2 = 2\|x\|^2 + 2\|y\|^2$ . Тождество параллелограмма.

**Определение 2.16.**  $(X, \rho)$  — метрическое пространство.  $x_1, x_2, \dots \in X, a \in X$ .

$\lim x_n = a$ , если

1. Вне любого открытого шара с центром в точке  $a$  содержится лишь конечное число членов последовательности.

2.  $\forall \varepsilon > 0 \exists N \forall n \geq N \quad \rho(x_n, a) < \varepsilon \iff x_n \in B_\varepsilon(a)$ .

**Определение 2.17.**  $A \subset X$ .

Тогда  $A$  — ограничено, если оно содержится в некотором шаре.

**Свойства.** 1.  $a = \lim x \iff \rho(x_n, a) \rightarrow 0$ .

**Доказательство.**  $\forall \varepsilon > 0 \exists n > N \quad |\rho(x_n, a)| < \varepsilon$  — предел равен 0.  $\square$

2. Предел единственный.

**Доказательство.** Пусть  $\exists a = \lim x_n = b$ . Тогда мы, что  $B_r(a) \cap B_r(b) = \emptyset \implies \exists N_1, N_2, \forall n \geq \max\{N_1, N_2\} x_n \in B_r(a) \wedge x_n \in B_r(b)$ .  $\square$

3. Если  $a = \lim x_n, a = \lim y_n$ . То для перемешанной последовательности  $x_n$  и  $y_n$  предел такой же.

4.  $a = \lim x_n \implies$  для последовательности, в которой  $x_n$  взяты с конечной кратностью, то  $a$  будет пределом.



5. Если  $a = \lim x_n$ , то  $\lim x_{n_k} = a$ .
6. Последовательность имеет предел  $\implies$  она ограничена

**Доказательство.**  $\varepsilon = 1 \exists N \forall n \geq N \rho(x_n, a) < 1$ . Тогда  $R = \max\{\rho(x_1, a), \dots, \rho(x_{N-1}, a)\} + 1 \implies x_n \in B_R(a)$ .  $\square$

7. Если  $a = \lim x_n$ , то последовательность, полученная из  $\{x_n\}$  перестановкой членов имеет тот же предел.
8.  $a$  — предельная точка  $A \iff \exists a \neq \{x_n\} \in A: \lim x_n = a$ .

Более того,  $x_n$  можно выбирать так, что  $\rho(x_n, a)$  строго убывает.

**Доказательство.** " $\Rightarrow$ " Пусть  $\lim x_n = a$ . Возьмем  $B_r(a) \implies \exists N \forall n \geq N x_n \in B_r(a) \implies x_n B_r(a) \implies \dot{B}_r(a) \cap A \neq \emptyset \implies a$  — предельная точка.

" $\Leftarrow$ " Берем  $r_1 = 1$ .  $\dot{B}_{r_1}(a) \cap A \neq \emptyset$ . Берем оттуда точку, называем  $x_1 \neq a$ .  $r_2 = \frac{\rho(x_1, a)}{2}$ .  $\dot{B}_{r_2}(a) \cap A \neq \emptyset$ . Берем оттуда точку  $x_2 \neq a$ .  $r_3 = \frac{\rho(x_2, a)}{2}$ . И так далее.

Получили:  $x_n \neq a$  и  $\rho(x_n, a) < \frac{\rho(x_{n-1}, a)}{2} < \rho(x_{n-1}, a)$ .  $\rho(x_n, a) < \frac{1}{2^n} \rightarrow 0 \implies x_n = a$ .  $\square$

**Теорема 2.7** (об арифметических действиях с пределами).  $X$  — нормированное пространство,  $x_n, y_n \in X$ ,  $\lambda_n \in \mathbb{R}$ .  $\lim x_n = a$ ,  $\lim y_n = b$ ,  $\lim \lambda_n = \mu$ . Тогда:

1.  $\lim(x_n + y_n) = a + b$ .
2.  $\lim(x_n - y_n) = a - b$ .
3.  $\lim \lambda_n x_n = \mu a$ .
4.  $\lim \|x_n\| = \|a\|$ .
5. Если в  $X$  есть скалярное произведение, то  $\lim \langle x_n, t_n \rangle = \langle a, b \rangle$ .

**Доказательство.** 1.  $\rho(x_n + y_n, a + b) = \|(x_n + y_n - (a + b))\| = \|(x_n - a) + (y_n - b)\| \leq \|x_n - a\| + \|y_n - b\| = \rho(x_n, a) + \rho(y_n, b) \rightarrow 0$ .

2. Аналогично.

3.  $\rho(\lambda_n x_n, \mu a) = \|\lambda_n x_n - \mu a\| = \|\lambda_n x_n - \lambda_n a + \lambda_n a - \mu a\| \leq \|\lambda_n x_n - \lambda_n a\| + \|\lambda_n a - \mu a\| = |\lambda_n| \|x_n - a\| + |\lambda_n - \mu| \|a\| \rightarrow 0$ , так как  $|\lambda_n|$  — ограниченная,  $\|x_n - a\| = \rho(x_n, a) \rightarrow 0$ ,  $|\lambda_n - \mu| \rightarrow 0$ ,  $\|a\|$  — константа.

4.  $|\|x_n\| - \|a\|| \leq \|x_n - a\| = \rho(x_n, a) \rightarrow 0 \implies \lim \|x_n\| = \|a\|$

5.  $\langle x, y \rangle = \frac{1}{4}(\|x + y\|^2 - \|x - y\|^2) = \frac{1}{4}(\langle x + y, x + y \rangle - \langle x - y, x - y \rangle)$ . Тогда получаем  $4\langle x_n, y_n \rangle = \|x_n + y_n\|^2 - \|x_n - y_n\|^2 \rightarrow \|a + b\|^2 - \|a - b\|^2 = 4\langle a, b \rangle$ .  $\square$

**Определение 2.18.**  $\mathbb{R}^d$  — пространство с нормой  $\sqrt{x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_d^2}$ .

**Определение 2.19.** Покоординатная сходимость в  $\mathbb{R}^d$ :

$$x_n \in \mathbb{R}^d. x_n = (x_n^{(1)}, x_n^{(2)}, \dots, x_n^{(d)}) \xrightarrow{\text{покоординатно}} a = (a^{(1)}, a^{(2)}, \dots).$$

**Теорема 2.8.** в  $\mathbb{R}^d$  сходимость по метрике и покоординатная сходимость совпадает.

**Доказательство.** Метрика  $\implies$  покоординатная.  $\rho(x_n, a) \rightarrow 0 \implies 0 \leq (x_n^{(1)} - a^{(1)})^2 + \dots + (x_n^{(d)} - a^{(d)})^2 = \rho(x_n, a)^2 \rightarrow 0 \implies \lim (x_n^{(k)} - a^{(k)})^2 = 0 \implies \lim x_n^{(k)} = a^{(k)} \implies$  покоординатная сходимость.

Покоординатная  $\implies$  метрика. Пусть  $|x_n^{(k)} - a^{(k)}| \rightarrow 0 \quad \forall k \implies (x_n^{(k)} - a^{(k)})^2 \rightarrow 0 \implies \sum_{k=1}^d (x_n^{(k)} - a^{(k)})^2 \rightarrow 0$ . А так как  $(\dots)^2 = \rho(x_n, a)^2 \implies \rho(x_n, a) \rightarrow 0$ .  $\square$

**Определение 2.20.**  $x_n \in X$  — фундаментальная последовательность, если

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N \forall m, n \geq N: \rho(x_n, x_m) < \varepsilon.$$

**Свойства.** 1. Сходящаяся последовательность фундаментальна.

2. Фундаментальная последовательность ограничена.

3. Если у последовательности есть сходящаяся подпоследовательность, то последовательность имеет предел.

**Доказательство.** Упражнение! Утверждается, что так же, как и в пределах.  $\square$

**Определение 2.21.**  $(X, \rho)$  — метрическое пространство — полное, если любая фундаментальная последовательность имеет предел.

**Пример.**  $\mathbb{R}$ :  $\rho(x, y) = |x - y|$  — полное.

**Упражнение.**  $(X, \rho)$  — полное метрическое пространство  $X \supset Y$  замкнуто. Доказать, что  $(Y, \rho)$  — полное.

**Упражнение.**  $(0, 1)$  не полное.  $x_n = \frac{1}{n}$  — фундаментальная, но  $\lim \frac{1}{n} = 0 \notin (0, 1)$ .

**Теорема 2.9.**  $\mathbb{R}^d$  — полное.

**Доказательство.** Пусть  $x_n$  — фундаментальная, то есть

$$\forall \varepsilon > 0 \exists N \forall m, n \geq N: \rho(x_n, x_m) = \sqrt{(x_n^{(1)} - x_m^{(1)})^2 + \dots + (x_n^{(d)} - x_m^{(d)})^2} < \varepsilon.$$

Но мы знаем, что  $\rho(x_n, x_m) \geq |x_n^{(k)} - x_m^{(k)}|$ . Тогда заметим, что  $x_n^{(k)}$  — фундаментальная  $\implies \exists a^{(k)} = \lim_{n \rightarrow \infty} x_n^{(k)}$ . Значит и  $x_n$  сходится к  $a$  по координатам  $\implies \rho(x_n, a) \rightarrow 0 \implies x_n$  сходится к  $a$  по метрике.  $\square$

## 2.2. Компактность

**Определение 2.22.**  $A, U_\alpha, \alpha \in I$ .

Множества  $U_\alpha$  — покрытие множества  $A$ , если  $A \subset \bigcup_{\alpha \in I} U_\alpha$ .

**Определение 2.23.** Открытое покрытие — покрытие открытыми множествами.

**Определение 2.24.**  $(X, \rho)$  — метрическое пространство,  $K \subset X$ .

$K$  — компакт, если из любого его открытого покрытия можно выделить конечное подпокрытие.

**Определение 2.25.** То есть для любого покрытия можно выбрать  $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_n \in I: K \subset \bigcup_{i=1}^n U_{\alpha_i}$

**Теорема 2.10** (Теорема о свойствах компактных множеств). 1.  $K \subset Y \subset X$ . Тогда  $K$  — компакт в  $(X, \rho) \iff K$  — компакт в  $(Y, \rho)$ .

2.  $K$  — компакт  $\implies K$  замкнуто и ограничено.

3. Замкнутое подмножество компакта — компакта.

**Доказательство.** 1.  $\Leftarrow$ . Пусть  $G_\alpha$  покрытие  $K$  множествами в  $X$ . Тогда  $U_\alpha = G_\alpha \cap Y$  — открытыми в  $Y$  и  $K \subset \bigcup_{\alpha \in I} U_\alpha = \bigcup_{\alpha \in I} G_\alpha \cap Y = (\bigcup_{\alpha \in I} G_\alpha) \cap Y$ .

$U_\alpha$  — открытое покрытие в  $(Y, \rho) \implies$  можно выделить конечное подпокрытие  $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ , такое что  $K \subset \bigcup_{i=1}^n U_{\alpha_i} \subset \bigcup_{i=1}^n G_{\alpha_i}$  — конечное подпокрытие  $G_\alpha \implies K$  компакт в  $(X, \rho)$ .

$\Rightarrow$ . Воспользуемся тем же наблюдением:  $U_\alpha = G_\alpha \cap Y$ . Следовательно можно выбрать  $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_n$  в  $X$  и они же подойдут и в  $Y$ .

2. Ограниченность. Возьмем  $a \in X$ . Тогда  $K \subset \bigcup_{n=1}^{\infty} B_n(a) = X$  — открытое покрытие  $K$ .

Выделим конечное подпокрытие  $K \subset \bigcup_{n=1}^N B_n(a) \implies K \subset B_N(a) \implies K$  — ограничено.

Замкнутость. Надо доказать, что  $X \setminus K$  — открытое. Возьмем  $a \in X \setminus K$  и докажем, что  $a$  лежит в  $X \setminus K$  вместе с некоторым шариком.

Пусть  $U_x = B_{(\rho(x,a)/2)}(x)$ . Причем он не пересекается с  $B_x = B_{\rho(x,a)/2}(a)$ . Возьмем тогда  $K \subset \bigcup_{x \in K} U_x$  — открытое покрытие. Выделим конечное подпокрытие  $K \subset \bigcup_{i=1}^n U_{x_i}$ ,  $r = \min\{\frac{\rho(x_i, a)}{2}\}$ .

Тогда  $B_r(a) = \bigcap_{i=1}^n B_{x_i}$ .  $B_r(a) \cap \bigcup_{i=1}^n U_{x_i} = \emptyset \implies B_r(a) \cap K = \emptyset \implies B_r(a) \subset X \setminus K \implies a$  — внутренняя  $X \setminus K$ .

3. Пусть  $\tilde{K}$  — компакт,  $K$  — замкнуто и  $K \subset \tilde{K}$ .

Рассмотрим открытое покрытие  $K$   $U_\alpha$ . Тогда  $\tilde{K}$  покрыто  $(X \setminus K) \cup \bigcup_{\alpha \in I} U_\alpha$  — открытое

покрытие  $\tilde{K}$ . Выделим конечное покрытие  $X \setminus K, U_{\alpha_1}, \dots, U_{\alpha_n}$ .  $K \subset X \setminus K \cup \bigcup_{i=1}^n U_{\alpha_i} \implies$

$K \subset \bigcup_{i=1}^n U_{\alpha_i}$  — открытое множество, а значит  $K$  — компакт.

□

**Теорема 2.11.**  $K_\alpha$  — семейство компактов, такое что пересечение любого конечного числа из них непусто. Тогда  $\bigcap_{\alpha \in I} K_\alpha \neq \emptyset$ .

**Следствие.**  $K_1 \subset K_2 \subset K_3 \subset \dots$  непустые компакты. Тогда  $\bigcap_{n=1}^{\infty} K_n \neq \emptyset$ .

**Доказательство.** От противного. Пусть  $\bigcap_{\alpha \in I} K_\alpha = \emptyset$ . Зафиксируем компакт  $K_0 \implies K_0 \cap \bigcap_{\alpha \in I} K_\alpha = \emptyset \implies K_0 \subset X \setminus \bigcap_{\alpha \in I} K_\alpha = \bigcup_{\alpha \in I} X \setminus K_\alpha$  — открытое покрытие  $K_0$ . Выделим конечное подпокрытие  $K_0 \subset \bigcup_{i=1}^n X \setminus K_{\alpha_i} = X \setminus \bigcap_{i=1}^n K_{\alpha_i} \implies K_0 \cap \bigcap_{i=1}^n K_{\alpha_i} = \emptyset$ .??!

□

**Определение 2.26.**  $K$  — секвенциально компактное множество, если из любой последовательности точек из  $K$  можно выделить подпоследовательность, которое сходится к какой-то точке из  $K$ .

**Пример.**  $[a, b] \in \mathbb{R}$  секвенциально компактно.

$x_n \in [a; b] \xrightarrow{\text{Т. Б-В}} \exists$  подпоследовательность  $x_{n_k}$ , имеющая предел  $\Rightarrow \lim x_{n_k} \in [a, b]$ , так как неравенства сохраняются.

**Теорема 2.12.** Бесконечное подмножество компакта имеет предельную точку.

**Доказательство.**  $K$  — компакт.  $A \subset K$ . Пусть  $A' = \emptyset$ . Тогда  $A$  — замкнуто  $\Rightarrow A$  — компакт и ни одна из его точек не является предельной  $a \in A$  не предельная  $\Rightarrow \exists r_a > 0 \ B_{r_a}(a) \cap A = \emptyset \Rightarrow B_{r_a}(a) \cap A = \{a\}$ . Рассмотрим открытое покрытие  $A \subset \bigcup_{a \in A} B_{r_a}(a)$ , но из этого покрытия нельзя убрать ни одного множества  $\Rightarrow$  нет конечного подпокрытия  $\Rightarrow$  противоречие.  $\square$

**Следствие.** Компактность  $\Rightarrow$  секвенциальная компактность.

**Доказательство.**  $x_1, x_2, \dots \in K$ .  $D = \{x_1, x_2, x_3, \dots\}$  — множество значений последовательности.

1.  $|D| < +\infty \Rightarrow$  есть элемент, повторяющийся бесконечно много раз, оставим только его — это нужная подпоследовательность.

2.  $|D| = +\infty \Rightarrow$  у  $D$  есть предельная точка.

Пусть  $a$  — предельная точка  $D \Rightarrow$  найдутся различные  $y_1, y_2, \dots \in D$ , такие что  $\lim y_n = a$ .

Но  $y_i$  — это какой-то  $x_{n_i}$   $\lim x_{n_i} = a$ . Осталось переставить  $x_{n_i}$  так, что получится последовательность. Ну, а так как  $K$  — замкнуто, то  $a \in K$ .

$\square$

**Лемма (Лемма Лебега).**  $K$  — секвенциальный компакт,  $K \subset \bigcup_{\alpha \in I} U_\alpha$  — открытое покрытие.

Тогда  $\exists r > 0: \forall x \in K \ B_r(x)$  целиком покрывается каким-то  $U_\alpha$ .

**Доказательство.** От противного. Тогда  $r = \frac{1}{n}$  не подходит  $\Rightarrow \exists x_n \in K: B_{\frac{1}{n}}(x_n)$  не содержится целиком ни в каком  $U_\alpha$ .

Выберем подпоследовательность  $x_{n_k}$ , такую что  $\lim x_{n_k} = a \in K$ .

Тогда  $a \in U_\beta$  для некоторого  $\beta \in I \Rightarrow \exists B_\varepsilon(a) \subset U_\beta$ . Возьмем  $N_1: \forall k \geq N_1 \ \rho(x_{n_k}, a) < \frac{\varepsilon}{2}$ . А еще можно взять  $N_2: \forall k \geq N_2 \ \frac{1}{n_k} < \frac{\varepsilon}{2}$ . А значит  $B_{\frac{1}{n_k}} \subset B_\varepsilon(a) \subset U_\beta$  при  $k \geq \max\{N_1, N_2\}$ !!

Докажем  $B_{\frac{1}{n_k}} \subset B_\varepsilon(a)$ : Если  $x \in B_{\frac{1}{n_k}}(x_{n_k})$   $\rho(x_{n_k}, x) < \frac{1}{n_k} < \frac{\varepsilon}{2} \wedge \rho(x_{n_k}, a) < \frac{\varepsilon}{2} \Rightarrow \rho(x, a) \leq \rho(x_{n_k}, x) + \rho(x_{n_k}, a) < \varepsilon$   $\square$

**Теорема 2.13.** Компактность = секвенциальная компактность.

**Доказательство.**  $\Rightarrow$  Пусть  $K \subset \bigcup_{\alpha \in I} U_\alpha$  — открытое покрытие. Возьмем  $r > 0$  из леммы Лебега. Рассмотрим открытое покрытие  $K \subset \bigcup_{x \in K} B_r(x)$ .

Достаточно из него выделить конечное подпокрытие. Возьмем  $x_1 \in K$ . Если  $B_r(x_1) \supset K$ , то выбрали конечное покрытие. Иначе берем  $x_2 \in K \setminus B_r(x_1)$ . Если объединение шариков  $\supset K$ , то выбрали конечное подпокрытие. Иначе продолжаем процесс:  $x_n \in K \setminus \bigcup_{i=1}^{n-1} B_r(x_i)$ . Если процесс оборвался, то выделили конечное подпокрытие.

Если он не оборвался, то мы построили последовательность  $x_1, x_2, \dots$ . Причем  $x_n, x_k \geq r \forall n > k \Rightarrow \rho(x_i, x_j) \geq r \forall i \neq j$ . Из такой последовательности не выбрать сходящуюся подпоследовательность, так как любая подпоследовательность не фундаментальная.  $\square$

**Определение 2.27.**  $A \subset X$ .  $(X, \rho)$  — метрическое пространство.

$E \subset A$ ,  $\varepsilon$ -сеть множества  $A$ , если  $\forall a \in A \exists x \in E: \rho(x, a) < \varepsilon$ .

Конечная  $\varepsilon$ -сеть —  $E$  — конечное множество.

То есть  $\{x_1, x_2, \dots, x_n\} \subset A$  —  $\varepsilon$ -сеть, если  $\forall a \in A \exists k \quad \rho(a, x_k) < \varepsilon$ .

**Определение 2.28.**  $A$  — вполне ограничено, если  $\forall \varepsilon > 0 \exists$  конечная  $\varepsilon$ -сеть  $A$ .

**Свойства.** 1. Вполне ограниченность  $\implies$  ограниченность.

**Доказательство.**  $\varepsilon = 1$  и конечная 1-сеть  $x_1, x_2, \dots, x_n$ .  $A \subset \bigcup_{k=1}^n B_r(x_k) \subseteq B_{r+1}(x_1)$ , где  $r = \max_{i \neq j} \rho(x_i, x_j)$ . □

2. В  $\mathbb{R}^d$  ограниченность  $\implies$  вполне ограниченность.

**Доказательство.**  $A \subset \mathbb{R}^d$  — ограниченное.  $A \subset B_R(O) \subset [-R, R]^d$ .

Зафиксируем  $\varepsilon > 0$  и возьмем  $n \in \mathbb{N}$ .  $\rho(x_i, a) \leq 2n$  диагональ  $= \sqrt{d} \frac{2R}{n} < \varepsilon$  при  $n > \frac{\sqrt{d} 2R}{\varepsilon}$  получается  $\varepsilon$ -сеть. □

**Теорема 2.14** (Хаусдорфа). 1. Компактное множество вполне ограничено.

2. Если  $(X, \rho)$  — полное метрическое пространство, то замкнуто вполне ограниченное подмножество  $X$  — компактно.

**Доказательство.** 1. Берем  $\varepsilon > 0$   $K \subset \bigcup_{x \in K} B_\varepsilon(x)$  — открытое покрытие. Выделим конечное подпокрытие  $\implies K \subset \bigcup_{i=1}^n B_\varepsilon(x_i) \implies x_1, \dots, x_n$  —  $\varepsilon$ -сеть.

2. Проверим секвенциальную компактность. Берем  $x_1, x_2, \dots \in K$ . Возьмем 1-сеть  $K \subset \bigcup_{i=1}^{n_1} B_1(y_{1i})$ .

В каком-то шарике бесконечное число членов последовательности. Выкинем все, кроме них  $x_{11}, x_{12}, x_{13}, \dots$ . Возьмем  $\frac{1}{2}$ -сеть.  $K \subset \bigcup_{i=1}^{n_2} B_{\frac{1}{2}}(y_{2i})$ . В каком-то шарике бесконечное число членов последовательности...

На  $j$ -ом шаге  $K \subset B_{\frac{1}{j}}(y_{ji})$ . Пусть на каждом шаге выбирали шарик  $B_{\frac{1}{i}}(z_i)$ .

В итоге получили:

$$\begin{array}{cccccc} x_{11} & x_{12} & x_{13} & x_{14} & \dots & B_1(z_1) \\ x_{21} & x_{22} & x_{23} & x_{24} & \dots & B_{\frac{1}{2}}(z_2) \\ x_{31} & x_{32} & x_{33} & x_{34} & \dots & B_{\frac{1}{3}}(z_3) \\ x_{41} & x_{42} & x_{43} & x_{44} & \dots & B_{\frac{1}{4}}(z_4) \end{array}$$

Воспользуемся диагональным методом Кантора. Пусть  $a_n := x_{nn}$ . Заметим, что  $a_n, a_{n+1}, a_{n+2}$  — последовательность  $x_{n1}, x_{n2}, x_{n3}, \dots \implies$  все лежат в  $B_{\frac{1}{n}}(z_n) \implies \rho(a_i, a_j) \leq \rho(a_i, z_n) + \rho(a_j, z_n) < \frac{2}{n}$ , при  $i, j \geq n \implies a_i$  — фундаментальная  $\implies$  у нее есть предел  $\implies a = \lim a_n \in K$ , так как  $K$  — замкнуто. Следовательно,  $K$  — секвенциально компактно. □

**Следствие Характеристика компактов в  $\mathbb{R}^d$ .**  $K$  — компакт  $\iff K$  — замкнуто и ограничено.

**Доказательство.**  $\Rightarrow$  верна всегда и доказано выше.

А вот  $\Leftarrow$  верна не всегда. Поэтому докажем эту штуку для  $\mathbb{R}^d$ . Мы знаем, что  $\mathbb{R}^d$  — полное. А еще мы знаем, что в  $\mathbb{R}^d$  ограниченность  $\Rightarrow$  вполне ограниченность, а значит понятно, что  $K$  — компакт.  $\square$

**Упражнение.**  $(K, \rho)$  — метрическое пространство,  $K$  — компакт. Доказать, что  $(K, \rho)$  — полное.

**Следствие теорема Больцано-Вейерштрасса в  $\mathbb{R}^d$ .** Из любой ограниченной последовательности в  $\mathbb{R}^d$  можно выбрать сходящуюся подпоследовательность.

**Доказательство.**  $\{x_n\} \Rightarrow \exists R \ x_n \in B_R(a) \subset \overline{B}_R(a)$  — замкнуто и ограничено  $\Rightarrow$  компактно  $\Rightarrow$  секвенциально компактно  $\Rightarrow x_n$  — последовательность точек секвенциального компакта  $\Rightarrow$  у нее есть сходящаяся последовательность.  $\square$

## 2.3. Непрерывные отображения

**Определение 2.29.**  $(X, \rho_X)$  и  $(Y, \rho_Y)$  — метрические пространства,  $E \subset X$ .  $f: E \rightarrow Y$ ,  $a$  — предельная точка  $E$ ,  $b \in Y$ .

$b = \lim_{x \rightarrow a} f(x)$  означает, что

По Коши:  $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall x: \rho_X(x, a) < \delta \wedge a \neq x \in E \Rightarrow \rho_Y(f(x), b) < \varepsilon$ .

В терминах окрестностей:  $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0: f(\dot{B}_\delta(a) \cap E) \subset B_\varepsilon(b)$

По Гейне:  $\forall$  последовательности  $a \neq x_n \in E: \lim x_n = a \Rightarrow \lim f(x_n) = b$

**Теорема 2.15.** Все определения равносильны.

**Доказательство.** Упражнение (смотри доказательство для последовательностей).  $\square$

**Теорема 2.16** (Критерий Коши).  $f: E \subset X \rightarrow Y$ ,  $Y$  — полное,  $a$  — предельная точка  $E$ . Тогда

$$\lim_{x \rightarrow a} f(x) \iff \forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall x, y \in \dot{B}_\delta(a) \cap E \Rightarrow \rho_Y(f(x), f(y)) < \varepsilon.$$

**Доказательство.**  $\Rightarrow$ . Упражнение: взять доказательство и заменить модуль на  $\rho$ .

$\Leftarrow$ . Проверим определение по Гейне. Надо доказать, что  $a \neq x_n \in E \wedge \lim x_n = a \Rightarrow \lim f(x_n)$  существует.

$f(x_n)$  — последовательность в  $Y$  — полное. Поэтому достаточно проверить, что  $f(x_n)$  — фундаментальная последовательность. Возьмем  $\varepsilon > 0$ , по нему  $\delta > 0$  из условия. По  $\delta > 0$  берем  $N$ , такое что  $\forall n \geq N: \rho_X(x_n, a) < \delta \Rightarrow x_n \in \dot{B}_\delta(a) \cap E$  при  $n \geq N \Rightarrow \forall m, n \geq N: \rho(f(x_n), f(x_m)) < \varepsilon$  фундаментальная  $\Rightarrow f(x_n)$  имеет предел.  $\square$

**Теорема 2.17** (об арифметических действиях с пределами).  $f, g: E \subset X \rightarrow Y$ ,  $Y$  — нормированное пространство,  $a$  — предельная точка  $E$ .

Пусть  $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = b, \lim_{x \rightarrow a} g(x) = c \wedge \alpha, \beta \in \mathbb{R}$ . Тогда

$$1. \lim_{x \rightarrow a} \alpha f(x) + \beta g(x) = \alpha b + \beta c.$$

$$2. \text{ Если } \lambda: E \rightarrow \mathbb{R}, \text{ такое что } \lim_{x \rightarrow a} \lambda(x) = \mu \in \mathbb{R}, \text{ то } \lim_{x \rightarrow a} \lambda(x)f(x) = \mu b.$$

$$3. \lim_{x \rightarrow a} \|f(x)\| = \|b\|$$

4. Если  $Y$  — пространство со скалярным произведением, то  $\lim_{x \rightarrow a} \langle f(x), g(x) \rangle = \langle b, c \rangle$ .
5. Если  $Y = \mathbb{R}$  и  $c \neq 0$ , то  $\lim_{x \rightarrow a} \frac{f(x)}{g(x)} = \frac{b}{c}$ .

**Доказательство.** Проверка по Гейне. Берем  $x_n \rightarrow a$ , тогда  $f(x_n) \rightarrow b, g(x_n) \rightarrow c$  и теорема про пределы последовательности.  $\square$

**Определение 2.30.**  $(X, \rho_X)$  и  $(Y, \rho_Y)$  — метрические пространства,  $E \subset X, a \in E$ .  $f: E \rightarrow Y$ ,  $f$  непрерывна в точке  $a$ , если

1.  $a$  не предельная точка или  $a$  — предельная и  $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = f(a)$ .
2. По Коши.  $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall x \in E: \rho_X(x, a) < \delta \Rightarrow \rho_Y(f(x), f(a)) < \varepsilon$ .
3. С окрестностями.  $\forall B_\varepsilon(f(a)) \exists B_\delta(a): f(B_\delta(a)) \subset B_\varepsilon(f(a))$ .
4. По Гейне:  $\forall x_n \in E: \lim x_n = a \Rightarrow \lim f(x_n) = f(a)$ .

**Доказательство.** Упражнение!  $\square$

**Теорема 2.18** (о непрерывности композиции).  $(X, \rho_X), (Y, \rho_Y), (Z, \rho_Z) — D \subset X, E \subset Y, a \in D, f: D \rightarrow E, g: E \rightarrow Z$ . Если  $f$  непрерывна в точке  $a$ , а  $g$  непрерывна в точке  $f(a)$ , то  $g \circ f$  непрерывна в точке  $a$ .

**Доказательство.**

$$\left. \begin{array}{l} \forall B_\varepsilon(g(f(a))) \exists B_\delta(f(a)): g(B_\delta(f(a)) \cap E) \subset B_\varepsilon(g(f(a))) \\ \forall B_\delta(f(a)) \exists B_\gamma(a): f(B_\gamma(a) \cap D) \subset B_\delta(f(a)) \cap E \end{array} \right\} \\ \Rightarrow g(f(B_\gamma(a) \cap D)) \subset g(B_\delta(f(a)) \cap E) \subset B_\varepsilon(g(f(a))) \Rightarrow g \circ f \text{ непрерывна в точке } a$$

$\square$

**Теорема 2.19** (Характеристика непрерывности в терминах открытых множеств).  $f: X \rightarrow Y$ . Тогда

$f$  непрерывна во всех точках  $\iff \forall U$  — открытого в  $Y: f^{-1}(U) := \{x \in X \mid f(x) \in U\}$  — открыто в  $X$ .

**Доказательство.**  $\Rightarrow$ . Берем  $a \in f^{-1}(U) \Rightarrow f(a) \in U$  — открыто  $\Rightarrow \exists \varepsilon > 0 \quad B_\varepsilon(f(a)) \subset U$ .

$f$  непрерывно в точке  $a \Rightarrow \exists \delta > 0: f(B_\delta(a)) \subset B_\varepsilon(f(a)) \subset U \Rightarrow B_\delta(a) \subset f^{-1}(U) \Rightarrow a$  — внутренняя точка  $f^{-1}(U) \Rightarrow f^{-1}(U)$  — открыто.

$\Leftarrow$ .  $U := B_\varepsilon(f(a))$  — открыто  $\Rightarrow f^{-1}(B_\varepsilon(f(a)))$  — открыто и  $a \in f^{-1}(B_\varepsilon(f(a))) \Rightarrow \exists \delta > 0 \quad B_\delta(a) \subset f^{-1}(B_\varepsilon(f(a))) \Rightarrow f(B_\delta(a)) \subset B_\varepsilon(f(a)) \Rightarrow f$  непрерывна в точке  $a$ .  $\square$

**Теорема 2.20** (Непрерывный образ компакта — компакт).  $(X, \rho_X), (Y, \rho_Y)$  — метрические пространства,  $K \subset X, K$  — компакт.

$f: K \rightarrow Y$  непрерывна во всех точка. Тогда  $f(K)$  — компакт.

**Доказательство.** Рассмотрим открытое покрытие  $f(K) \subset \bigcup_{\alpha \in I} U_\alpha$  — открытые  $\Rightarrow K \subset f^{-1}(\bigcup_{\alpha \in I} U_\alpha) = \bigcup_{\alpha \in I} f^{-1}(U_\alpha)$  по непрерывности  $f$   $f^{-1}(U_\alpha)$  — открыто  $\Rightarrow$  это открытое покрытие  $K$ , но  $K$  — компакт  $\Rightarrow$  выбираем конечное подпокрытие  $K \subset \bigcup_{j=1}^n f^{-1}(U_{\alpha_j}) = f^{-1}(\bigcup_{j=1}^n U_{\alpha_j}) \Rightarrow$

$f(K) \subset \bigcup_{j=1}^n U_{\alpha_j}$ . Нашли конечное подпокрытие  $\Rightarrow f(K)$  — компакт.  $\square$

**Определение 2.31.**  $f: E \subset X \rightarrow Y$  — ограниченное отображение, если  $f(E)$  — ограниченное множество.

**Следствие.** Непрерывный образ компакта замкнут и ограничен.

**Доказательство.** Знаем, что непрерывный образ компакта — компакт. А следовательно, образ замкнут и ограничен.  $\square$

**Следствие.** Если  $K$  — компакт и  $f$  непрерывна на  $K$ , то  $f$  — ограниченное отображение.

**Следствие Теорема Вейерштрасса.**  $f: K \rightarrow \mathbb{R}$ ,  $K$  — компакт,  $f$  непрерывна на  $K$ .

Тогда  $\exists a, b \in K: f(a) \leq f(x) \leq f(b) \quad \forall x \in K$ .

**Доказательство.**  $f(K)$  — ограниченное множество в  $\mathbb{R} \implies B := \sup_{x \in K} f(x) \in \mathbb{R} \implies \exists x_n \in K: \lim f(x_n) = B$ . При этом  $x_n \in K$  — секвенциальный компакт  $\implies$  существует сходящаяся подпоследовательность  $x_{n_k}$ .

Тогда  $\lim x_{n_k} =: b \in K \implies \lim f(x_{n_k}) = f(b) \implies f(b) = \sup_{x \in K} f(x) = B \implies f(x) \leq f(b) \quad \forall x \in K$ .  $\square$

**Теорема 2.21.**  $f: X \rightarrow Y$  непрерывна во всех точках, биекция и  $X$  — компакт. Тогда  $f^{-1}$  непрерывна во всех точках.

**Доказательство.** Проверяем непрерывность  $f^{-1}$  в терминах открытых множеств. Надо для  $f^{-1}$  проверить, что прообраз открытого — открыт, то есть для  $f$  проверить, что образ открытого открыт.

$U$  — открыто в  $X \implies X \setminus U$  — замкнуто  $\subset X$  — компакт  $\implies X \setminus U$  — компакт  $\implies f(X \setminus U) = Y \setminus f(U)$  — компакт  $\implies Y \setminus f(U)$  — замкнуто  $\implies f(U)$  — открыто.  $\square$

**Определение 2.32.**  $f: E \subset X \rightarrow Y$  равномерно непрерывна, если  $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall x, y \in E: \rho_X(x, y) < \delta \implies \rho_Y(f(x), f(y)) < \varepsilon$ .

**Теорема 2.22** (Теорема Кантора).  $f: K \rightarrow Y$  непрерывна,  $K$  — компакт. Тогда  $f$  равномерно непрерывна.

**Доказательство.** Берем  $x \in K$ ,  $f$  непрерывна в точке  $x \implies \exists r_x > 0: f(B_{r_x}(x)) \subset B_{\frac{\varepsilon}{2}}(f(x))$ .

Тогда  $K \subset \bigcup_{x \in K} B_{r_x}(x)$  — открытое покрытие  $K$ . Возьмем  $\delta > 0$  из леммы Лебега, то есть  $\forall x \in K B_\delta(x)$  целиком попал в какой-то элемент покрытия.

Проверим, что это  $\delta > 0$  подходит в определение равномерной непрерывности.

$x, y \in K, \rho_X(x, y) < \delta \implies y \in B_\delta(x) \implies \exists a \in K: B_\delta(x) \subset B_{r_x}(a) \implies x, y \in B_{r_x}(a) \implies f(x), f(y) \in B_{\frac{\varepsilon}{2}}(f(a)) \implies \rho_Y(f(x), f(a)) < \frac{\varepsilon}{2} \wedge \rho_Y(f(y), f(a)) < \frac{\varepsilon}{2} \implies \rho_Y(f(x), f(y)) < \varepsilon$   $\square$

**Определение 2.33.**  $X$  — векторное пространство и  $\|\cdot\|$  и  $\|\cdot\|_1$  — норм в  $X$ . Нормы эквивалентны, если  $\exists C_1, C_2 > 0$

$$C_1 \|x\| \leq \|x\|_1 \leq C_2 \|x\| \quad \forall x \in X.$$

**Замечание.** 1. Это отношение эквивалентности. (упражнение)

2. Пределы последовательности для эквивалентных норм совпадают. Док-во: Пусть  $\lim x_n = a$  по норме  $\|\cdot\|$ , т.е.  $\lim \|x_n - a\| = 0$ . А  $0 \leq \|x_n - a\|_1 \leq C_2 \|x_n - a\| \rightarrow 0$ , значит  $\lim x_n = a$  и по норме  $\|\cdot\|_1$ .



3. Непрерывность отображений для эквивалентных норм совпадают (записываем по Гейне, а для последовательностей мы всё знаем).

**Теорема 2.23.** В  $\mathbb{R}^d$  все нормы эквивалентны.

**Доказательство.**  $\|x\| = \sqrt{x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_d^2}$ . Достаточно доказать, что остальные норма эквивалентны.

Пусть  $p(x)$  — другая норма в  $\mathbb{R}^d$ .  $e_k$  — вектор с нулями и единицей на  $k$ -ой позиции.

$$\begin{aligned} x &= (x_1, x_2, \dots, x_d) = \sum_{k=1}^d x_k e_k. \quad p(x - y) = p\left(\sum_{k=1}^d (x_k - y_k) e_k\right) \leq \sum_{k=1}^d p((x_k - y_k) e_k) = \sum_{k=1}^d |x_k - y_k| p(e_k) \\ &\leq (\text{Коши-Буняковский}) \left(\sum_{k=1}^d (x_k - y_k)^2\right)^{\frac{1}{2}} \left(\sum_{k=1}^d p(e_k)^2\right)^{\frac{1}{2}} = \left(\sum_{k=1}^d p(e_k)^2\right)^{\frac{1}{2}} \|x - y\| \implies \\ p(x) &\leq \left(\sum_{k=1}^d p(e_k)^2\right)^{\frac{1}{2}} \|x\|. \end{aligned}$$

$S := \{x \in \mathbb{R}^d : x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_d^2 = 1\}$  — компакт  $\implies \exists a \in S : 0 < p(a) \leq p(x) \quad \forall x \in S$ .

$$p(x) = p\left(\frac{x}{\|x\|} \cdot \|x\|\right) = \|x\| p\left(\frac{x}{\|x\|}\right) \geq \|x\| p(a).$$

Тогда  $p(a)\|x\| \leq p(x) \leq M\|x\| \quad \forall x \in \mathbb{R}^d$ . □

## 2.4. Длина кривой

**Определение 2.34.**  $(X, \rho)$  — метрическое пространство.  $(\mathbb{R}^d$  — ключевой случай).

$\gamma : [a, b] \rightarrow X$  непрерывное — путь.

$\gamma(a)$  — начало пути,  $\gamma(b)$  — конец пути.  $\gamma([a, b])$  носитель пути.

Замкнутый путь  $\gamma(a) = \gamma(b)$ . Простой (самонепересекающийся) путь:  $\gamma(u) \neq \gamma(v) \quad \forall u, v \in [a, b]$ . Возможно, за исключением равенства  $\gamma(a) = \gamma(b)$ .

**Определение 2.35.** Эквивалентные пути:  $\gamma_1 : [a, b] \rightarrow X$ ,  $\gamma_2 : [c, d] \rightarrow X$ . Если  $\exists u : [a, b] \rightarrow [c, d]$ ,  $u$  — непрерывна,  $u$  — строго монотонно возрастает,  $u(a) = c$ ,  $u(b) = d$ , такой, что  $\gamma_1 = \gamma_2 \circ u$ .

**Определение 2.36.** Класс эквивалентных путей — кривая.

Конкретный представитель класса — параметризация кривой.

**Определение 2.37.**  $\gamma : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}^d$ .  $r$ -гладкий путь, если  $\gamma = \begin{pmatrix} \gamma_1 \\ \gamma_2 \\ \vdots \\ \gamma_d \end{pmatrix}$ ,  $\gamma_j : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$  —  $r$ -гладкие функции, то есть  $\gamma_j \in C^r[a, b]$ .

Кривая гладкая, если у нее есть гладкая параметризация. Если  $r$  опущено, то  $r = 1$ .

**Определение 2.38.** Длина пути  $l(\gamma) = \sup \sum_{k=1}^n \rho(\gamma(t_k), \gamma(t_{k-1}))$ , где  $t_k$  — дробление отрезка.

**Замечание.** Длины эквивалентных путей равны.

**Свойства.** 1.  $l(\gamma) \geq \rho(\gamma(a), \gamma(b))$ . Можно просто взять дробление состоящее из двух точек.

2.  $l(\gamma) \geq$  длина вписанной в нее ломаной.

**Теорема 2.24.** Пусть есть  $\gamma : [a, b] \rightarrow X$ .  $c \in [a, b]$ .

$$l(\gamma) = l(\gamma|_{[a,c]}) + l(\gamma|_{[c,b]}).$$

Обозначим куски за  $\gamma_1, \gamma_2$ .

**Доказательство.** Нам нужно доказать какое-то равенство, поэтому докажем два неравенства!

- $\geq$ . Давайте вписывать ломанные. Впишем какую-то ломанную в  $\gamma_1$  и еще какую-то в  $\gamma_2$ . Пусть получились дробления  $a = t_0 < t_1 < t_2 < \dots < t_n = u_0 < \dots < u_m = b$  — получилось дробление  $[a, b]$ .

Тогда посчитаем сумму:  $\sum_{k=1}^n \rho(\gamma(t_{k-1}), \gamma(t_k)) + \sum_{k=1}^n \rho(\gamma(u_{k-1}), \gamma(u_k)) \leq l(\gamma)$ . Заменяем первое слагаемое на  $\sup$ :  $\sup \dots + \sum_{k=1}^n \rho(\gamma(u_{k-1}), \gamma(u_k)) \leq l(\gamma)$ . А этот  $\sup$  — длина  $\gamma_1$ . Встает вопрос почему можно переходить. Мы знаем, что все числа меньше, то и супремум меньше, поэтому переход корректный. Дальше заменяем правый  $\sup$ . В итоге получаем  $l(\gamma_1) + l(\gamma_2) \leq l(\gamma)$ .

- Возьмем дробление  $\gamma$   $t_i$ . Посмотрим на сумму  $S = \sum_{j=1}^n \rho(\gamma(t_{j-1}), \gamma(t_j))$ .

Возьмем дробление  $t_i$  и добавим в него точку  $c$ . Получаем:

$$S \leq \sum_{j=1}^k \rho(\gamma(t_{j-1}), \gamma(t_j)) + \rho(\gamma(t_k), \gamma(c)) + \rho(\gamma(c), \gamma(t_{k+1})) + \sum_{j=k+2}^n \rho(\gamma(t_{j-1}), \gamma(t_j))$$

А теперь увидим, что первые два слагаемых  $\leq l(\gamma_1)$ , а вторые два  $\leq l(\gamma_2)$ .

□

**Теорема 2.25.**  $\gamma: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}^d$  — гладкий путь.  $\gamma = \begin{pmatrix} \gamma_1 \\ \gamma_2 \\ \vdots \\ \gamma_d \end{pmatrix}$ . Тогда:

$$l(\gamma) = \int_a^b \|\gamma'(t)\| dt$$

**Лемма.**  $\Delta \subset [a, b]$  — отрезок,  $\gamma: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}^d$ .  $m_{\Delta}^{(i)} := \min_{t \in \Delta} |\delta'_i(t)|$ ,  $M_{\Delta}^{(i)} := \max_{t \in \Delta} |\delta'_i(t)|$ ,  $m_{\Delta} :=$

$$\sqrt{\sum_{i=1}^d (m_{\Delta}^{(i)})^2}, M_{\Delta} := \sqrt{\sum_{i=1}^d (M_{\Delta}^{(i)})^2}$$

Тогда  $m_{\Delta} l(\Delta) \leq l(\gamma|_{\Delta}) \leq M_{\Delta} l(\Delta)$ .

**Доказательство.** Впишем в  $\gamma|_{\Delta}$  ломаную. Пусть  $a_k$  — длина  $k$ -го звена.

По теореме Лагранжа:  $\gamma_i(t_k) - \gamma_i(t_{k-1}) = \underbrace{\gamma'_i(\xi_{ik})(t_k - t_{k-1})}_{\leq m_{\Delta}^{(i)}(t_k - t_{k-1})} \leq M_{\Delta}^{(i)}(t_k - t_{k-1})$

Тогда  $m_{\Delta}(t_k - t_{k-1}) \leq a_k \leq M_{\Delta}(t_k - t_{k-1})$ . Просуммируя все такие неравенства получим исходное. □

*Доказательство теоремы.*

$$\begin{aligned}
 m_k(x_k - x_{k-1}) &\leq l(\gamma|_{[x_{k-1}, x_k]}) \leq M_k(x_k - x_{k-1}) \\
 \sum_{k=1}^n m_k(x_k - x_{k-1}) &\leq l(\gamma) \leq \sum_{k=1}^n M_k(x_k - x_{k-1}) \\
 m_k(x_k - x_{k-1}) &\leq \int \sqrt{\gamma_1'(t)^2 + \dots + \gamma_d'(t)^2} dt \leq M_k(x_k - x_{k-1})
 \end{aligned}$$

Докажем, что  $\square$  (штука с  $M_k$ ) минус  $\bigcirc$  стремится к нулю. По факту хотим доказать, что  $\sum_{k=1}^n (M_k - m_k)(x_k - x_{k-1}) \rightarrow 0$ .

$$\begin{aligned}
 M_k - m_k &= \sqrt{\sum_{i=1}^d (M_{[x_{k-1}, x_k]}^{(i)})^2} - \sqrt{\sum_{i=1}^d (m_{[x_{k-1}, x_k]}^{(i)})^2} \leq (\text{Минковский}) \sqrt{\sum_{i=1}^d (M_{[x_{k-1}, x_k]}^{(i)} - m_{[x_{k-1}, x_k]}^{(i)})^2} \leq \\
 &\leq \sum_{i=1}^d (M_{[x_{k-1}, x_k]}^{(i)} - m_{[x_{k-1}, x_k]}^{(i)}) = \sum_{i=1}^d (\gamma_i(\xi_k) - \gamma_i(\eta_k)) \leq \sum_{l=1}^d \omega_k(|\tau|) \\
 0 &\leq \sum_{k=1}^n (M_k - m_k)(x_k - x_{k-1}) \leq \sum_{i=1}^d \omega_k(|\tau|) \cdot \sum_{k=1}^n (x_k - x_{k-1})
 \end{aligned}$$

□

**Следствие.** 1.  $\|\gamma'\| \leq C \implies l(\gamma) \leq C(b - a)$

2. Длина графика функции  $f: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$   $l = \int_a^b \sqrt{1 + f'(x)^2} dx$ .

3. Длина в полярных координатах.  $r: [\alpha, \beta] \rightarrow \mathbb{R}$ . Тогда  $l = \int_{\alpha}^{\beta} \sqrt{r(\varphi)^2 + r'(\varphi)^2} d\varphi$ .

**Доказательство.** 2.  $\gamma(x) = \begin{pmatrix} x \\ f(x) \end{pmatrix}$ ,  $\gamma_1'(x) = 1$ ,  $\gamma_2'(x) = f'(x)$ , а дальше применить функцию.

3.  $\gamma(\varphi) = \begin{pmatrix} r(\varphi) \cos \varphi \\ r(\varphi) \sin \varphi \end{pmatrix}$

□

**Определение 2.39.**  $A$  — связное множество, если  $\forall$  покрытие  $A \subset U \cup V$ ,  $U \cap V = \emptyset \implies$  либо  $A \subset U$ , либо  $A \subset V$ , где  $U, V$  — открытые.

**Пример.** 1.  $[a, b]$  — связное множество в  $\mathbb{R}$ .

2.  $\mathbb{Q}$  — несвязное множество в  $\mathbb{R}$ . Пример  $\mathbb{Q} \subset (-\infty; \sqrt{2}) \cup (\sqrt{2}; +\infty)$ .

**Теорема 2.26.** Непрерывный образ связного множества — связное множество.

**Доказательство.**  $A$  — связное,  $f: A \subset X \rightarrow Y$  непрерывное.  $f(a) \subset U \cup V$  — открытые в  $Y$  и  $U \cap V = \emptyset$ .  $A \subset f^{-1}(U) \cup f^{-1}(V)$ .  $f^{-1}(U) \cap f^{-1}(V) = \emptyset$ .  $A$  — связное  $\implies A \subset f^{-1}(U)$  или  $A \subset f^{-1}(V) \implies f(A) \subset U$  или  $f(a) \subset V \implies f(A)$  — связно. □

**Следствие Теорема Больцано-Коши.** Пусть  $A$  — связное,  $a, b \in A$ .  $f: A \rightarrow \mathbb{R}$  непрерывная.

Тогда  $f$  принимает все промежуточные значения, лежащие между  $f(a)$  и  $f(b)$ .

**Доказательство.** От противного. Пусть  $f(a) < C < f(b)$  и  $C$  — не значение. Тогда  $f(A) \subset (-\infty, C) \cup (C, +\infty)$ . Заметим, что данные множества открытые и не пересекаются. Тогда получили противоречие со связностью  $f(A)$ .  $\square$

**Теорема 2.27.**  $\langle a, b \rangle$  — связное подмножество  $\mathbb{R}$ ,  $a, b \in \overline{\mathbb{R}}$ .

**Доказательство.** От противного. Пусть  $\langle a, b \rangle \subset U \cap V$ ,  $U \cap V = \emptyset$ .

Пусть  $f: \langle a, b \rangle \rightarrow \mathbb{R} = f(x) = \begin{cases} 0 & x \in \langle a, b \rangle \cap U \neq \emptyset \\ 1 & x \in \langle a, b \rangle \cap V \neq \emptyset \end{cases}$  — непрерывная функция. Её прообраз:  $\emptyset, \langle a, b \rangle, \langle a, b \rangle \cap U, \langle a, b \rangle \cap V$  — открытые в  $\langle a, b \rangle$  множества, но значения  $\frac{1}{2}$  не принимаются.  $\square$

**Определение 2.40.**  $A$  — линейно связно, если  $\forall u, v \in A \exists \gamma: [a, b] \rightarrow A: \gamma(a) = u, \gamma(b) = v$ .

**Теорема 2.28.** Линейно связное множество связно.

**Доказательство.**  $A$  — линейно связно, пусть оно не связно  $\implies A \subset U \cup V$   $U \cap V = \emptyset$ .  $A \cap U \neq \emptyset$  и  $A \cap V \neq \emptyset$ .

Возьмем  $u \in A \cap U, v \in A \cap V$  и соединим их путем  $\gamma$ .  $\gamma[a, b]$  — связное (как образ отрезка),  $\gamma[a, b] \subset A \subset U \cup V \implies \gamma[a, b] \subset U$  или  $\gamma[a, b] \subset V$ . Противоречие.  $\square$

**Определение 2.41.** Область — открытое, линейно связное множество.

**Замечание.** Если  $A$  открыто, то  $A$  — связно  $\iff A$  — линейно связное.

## 2.5. Линейные операторы

**Определение 2.42.**  $X, Y$  — векторные пространства,

$A: X \rightarrow Y$  — линейный оператор, если  $\forall x, y \in X, \forall \alpha, \beta \in \mathbb{R} A(\alpha x + \beta y) = \alpha A(x) + \beta A(y)$ .

**Свойства.** 1.  $A0_X = 0_Y$ . Доказательство:  $\alpha = 0, \beta = 0$ .

2.  $A(\sum_{k=1}^n x_k) = \sum_{k=1}^n \lambda_k A(x_k)$ . Доказательство: индукция.

**Определение 2.43.**  $A, B$  — линейный оператор:  $X \rightarrow Y$ .

$(A + B)(x) := A(x) + B(x)$ .

$(\lambda A)(x) = \lambda A(x)$ .

То есть получили векторное пространство линейных операторов.

**Определение 2.44.**  $A: X \rightarrow Y, B: Y \rightarrow Z$  — линейные операторы  $B \circ A: X \rightarrow Z$ .  $(B \circ A)(x) := B(A(x))$ .

**Замечание.** Это линейный оператор.

**Определение 2.45.** Обратный оператор:  $A: X \rightarrow Y, B: Y \rightarrow X$  обратный к  $A$ , если  $A \circ B = Id_Y$  и  $B \circ A = Id_X$ .

**Свойства.** 1. Если обратный оператор  $\exists$ , то он единственный.

2.  $(\lambda A)^{-1} = \frac{1}{\lambda} A^{-1}$ .

3.  $A: X \rightarrow X$  — обратимые операторы образуют группу по операции композиции.

**Доказательство.** 1.  $B \circ A = Id_X \implies A$  — инъекция. Если  $A(x) = A(y) \implies x = B(A(x)) = B(A(y)) = y$ .

$A \circ B = Id_Y \implies A$  — сюръекция.  $A(B(y)) = y$ .

Пусть  $B, C$  — обратные к  $A$ .  $B(A(x)) = B \circ A(x) = x = C \circ A(x) = C(A(x))$ .

2.  $((\frac{1}{\lambda}A^{-1}) \circ (\lambda A))(x) = \frac{1}{\lambda}A^{-1}(\lambda A(x)) = x$ .

□

**Пример.**  $X = \mathbb{R}^n, Y = \mathbb{R}^m$ . Можно рассматривать линейные операторы как матрицы бла-бла-бла.

**Определение 2.46.**  $A: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$ . Возьмем базисный вектор  $e_k$  — везде, кроме  $k$ -ой позиции нули.

Пусть  $x = \sum_{i=1}^n x_i e_i$ . Тогда  $Ax = A(\sum_{k=1}^n x_k e_k) = \sum_{k=1}^n x_k A e_k$ .

То есть получили набор столбцов. Из которого можно получить матрицу.

**Определение 2.47.**  $X$  и  $Y$  — нормированные пространства.  $A: X \rightarrow Y$  — линейный оператор.

$$\|A\| := \sup_{\|x\|_X \leq 1} \|A x\|_Y.$$

Оператор ограниченный, если его норма конечна.

**Замечание.** Ограниченный оператор  $\neq$  ограниченное отображение.

Линейное отображение + ограниченность  $\implies = 0$ .

**Доказательство.** Пусть  $Ax \neq 0$ , тогда  $A(\lambda x) = \lambda Ax$ , а это уже не ограничено.

□

**Свойства.** 1.  $\|A + B\| \leq \|A\| + \|B\|$

2.  $\|\lambda A\| = |\lambda| \|A\|$ .

3.  $\|A\| = 0 \iff A \equiv 0$ .

**Доказательство.** 1.  $\|(A + B)x\|_Y = \|Ax + Bx\|_Y \leq \|Ax\|_Y + \|Bx\|_Y \iff \sup_{\|x\|_X \leq 1} \|(A + B)x\|_Y =$

$$\|A + B\| \leq \sup_{\|x\|_X \leq 1} \|Ax\|_Y + \sup_{\|x\|_X \leq 1} \|Bx\|_Y.$$

2.  $\|\lambda Ax\| = |\lambda| \cdot \|Ax\|$ .  $\sup_{\|x\|_X \leq 1} \|\lambda Ax\| = |\lambda| \sup_{\|x\|_X \leq 1} \|Ax\| = |\lambda| \|A\|$ .

3.  $\implies \|A\| = 0 \implies \|Ax\| = 0 \implies Ax = 0 \implies Ax = A(\frac{x}{\|x\|} \cdot \|x\|) = \|x\| A(\frac{x}{\|x\|}) = 0$ .

□

**Теорема 2.29.**  $A: X \rightarrow Y$  — линейный оператор. Тогда

$$\|A\| = \sup_{\|x\|_X \leq 1} \|Ax\|_Y = \sup_{\|x\|_X = 1} \|Ax\|_Y = \sup_{x \neq 0} \frac{\|Ax\|_Y}{\|x\|_X} = \inf\{c > 0 \mid \|Ax\|_Y \leq c\|x\|_X\}.$$

**Доказательство.** Обозначим за  $N_i$   $i$ -ый элемент этой цепочки.

$N_1 \geq N_2$  и  $N_1 \leq N_3$ , так как  $N_2, N_3 \subset N_1$ .

$N_3 \geq N_4$ .  $\frac{\|Ax\|_Y}{\|x\|_X} = \frac{1}{\|x\|} \|Ax\|_Y = \|A \frac{x}{\|x\|}\|_Y \leq N_3$ .

$$N_4 = N_5. \quad N_5 = \inf\{c > 0 \mid \frac{\|Ax\|_Y}{\|x\|_X} < c\}$$

Теперь докажем, что  $N_1 \leq N_2$ . Пусть  $\|x\| \leq 1 \implies \|(1-\varepsilon)x\| \leq 1 \implies \|A((1-\varepsilon)x)\| \leq N_2$ . Воспользуемся линейностью  $A$ : вытащим  $(1-\varepsilon)$  за скобку. После этого устремим  $\varepsilon$  к 0. Тогда  $\|Ax\| \leq N_2 \implies N_1 = \sup_{\|x\| \leq 1} \|Ax\| \leq 1$ .

Теперь докажем, что  $N_1 \leq N_4$ .  $\|x\| \leq 1$ . Тогда  $y := \frac{x}{\|x\|}$ ,  $\|y\| = 1 \implies \|A_y\| \leq N_4 \implies \|Ax\| \leq \frac{1}{\|x\|} \|A(\frac{x}{\|x\|})\| \leq N_4 \implies N_1 = \sup_{\|x\| \leq 1} \|Ax\| \leq N_4$ .  $\square$

**Теорема 2.30.**  $A: X \rightarrow Y$  — линейный оператор. Следующие условия равносильны:

1.  $A$  — ограниченный оператор.
2.  $A$  — непрерывна в нуле.
3.  $A$  — непрерывна во всех точках.
4.  $A$  — равномерно непрерывна.

**Доказательство.**  $4 \implies 3 \implies 2$  — очевидно.

$1 \implies 4$   $\|Ax - Ay\|_Y = \|A(x - y)\|_Y \leq \|A\| \cdot \|x - y\|_X$ . Если  $\|x - y\|_X < \frac{\varepsilon}{\|A\|}$ , то  $\|Ax - Ay\| < \varepsilon$ .

$2 \implies 1$ . Возьмем  $\varepsilon = 1$  и  $\delta > 0$  из определения непрерывности.  $\forall x \in X: \|x\| < \delta \implies \|Ax\| < 1$ .

Пусть  $\|y\| < 1$ . Тогда  $\|\delta y\| < \delta \implies \|A(\delta y)\| < 1 \implies \|Ay\| < \frac{1}{\delta} \implies \sum_{\|y\| < 1} \|Ay\| \leq \frac{1}{\delta}$ .  $\square$

**Следствие.** 1.  $\|Ax\|_Y \leq \|A\| \|x\|_X \quad \forall x \in X$ .

2.  $\|AB\| \leq \|A\| \cdot \|B\|$ .

**Доказательство.** 2.  $\|A(Bx)\| \leq \|A\| \cdot \|Bx\| \leq \|A\| \|B\| \|x\|$ .

$$\|AB\| = \inf\{c > 0 \mid \|A(Bx)\| \leq c \|x\|\} \implies \|AB\| \leq \|A\| \|B\|.$$

1. а где

$\square$

**Теорема 2.31.**  $A: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$ .  $A = \begin{pmatrix} a_{11} & \dots & a_{1n} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{m1} & \dots & a_{mn} \end{pmatrix}$ .

Тогда  $\|A\|^2 \leq \sum_{k=1}^n \sum_{j=1}^m a_{jk}^2$ . В частности, все такие операторы ограничены.

**Доказательство.**  $\|Ax\|^2 = \sum_{j=1}^m \left( \sum_{k=1}^n a_{jk} x_k \right)^2 \leq$  (Коши-Буняковский)  $\sum_{j=1}^m \sum_{k=1}^n a_{jk}^2 \underbrace{\sum_{k=1}^n x_k^2}_{=\|x\|^2}$ . Следова-

тельно,  $\|Ax\| \leq \|x\| \sqrt{\sum_{k=1}^m \sum_{j=1}^n a_{jk}^2}$  /  $\square$

**Замечание.** В бесконечномерном случае бывают неограниченные операторы.

## 3. Ряды

### 3.1. Ряды в нормированных пространствах

**Определение 3.1.**  $X$  — пространство с нормой,  $x_n \in X$ .

$\sum_{k=1}^{\infty} x_k$  — ряд. Частичная сумма ряда  $S_n := \sum_{k=1}^n x_k$ .

Если  $\exists \lim_{n \rightarrow \infty}$ , то он называется суммой ряда.

Ряд сходится, если у него есть сумма (и для  $\mathbb{R}$  эта сумма конечна), иначе она бесконечна.

**Теорема 3.1** (Необходимое условие сходимости). Если ряд  $\sum_{n=1}^{\infty} x_k$  — сходится, то  $\lim x_n = 0$ .

**Доказательство.**  $S_n := \sum_{k=1}^n x_k \rightarrow S \implies \underbrace{S_n - S_{n-1}}_{x_n} \rightarrow S - S = 0$ . □

**Свойства.** 1. Линейность.  $\sum_{n=1}^{\infty} (\alpha x_n + \beta y_n) = \alpha \sum_{n=1}^{\infty} x_n + \beta \sum_{n=1}^{\infty} y_n$ .

2. Расстановка скобок. В ряду произвольным образом можно ставить скобки, то расстановка скобок дает тот же результат.

**Набросок доказательства:** мы просто смотрим на предел подпоследовательности.

3. В  $\mathbb{C}$  и  $\mathbb{R}^n$  сходимость равносильна покоординатной сходимости.

**Теорема 3.2** (Критерий Коши).  $X$  — полное нормированное пространство.

Тогда ряд  $\sum_{n=1}^{\infty} x_n$  сходится  $\iff \forall \varepsilon > 0 \exists N \forall m, n \geq N: \left\| \sum_{k=m}^n x_j \right\| < \varepsilon$ .

**Доказательство.**  $S_n := \sum_{k=1}^n x_k$ . Последовательность  $S_n$  сходится  $\iff S_n$  — фундаментальная  $\iff \forall \varepsilon > 0 \exists N \forall m, n > N: \|S_n - S_m\| < \varepsilon \iff \left\| \sum_{k=m+1}^n x_k \right\| < \varepsilon$ . □

**Определение 3.2.** Ряд  $\sum_{n=1}^{\infty} x_n$  сходится абсолютно, если  $\sum_{n=1}^{\infty} \|x_n\|$  сходится.

**Замечание.** В частности, в  $\mathbb{R}$  абсолютная сходимость — сходимость ряда  $\sum_{n=1}^{\infty} \|x_n\|$ .

**Теорема 3.3.**  $X$  — полное нормированное пространство.

Если  $\sum_{n=1}^{\infty} x_n$  абсолютно сходится, то он абсолютно сходится.

**Доказательство.** Пусть  $\sum_{n=1}^{\infty} \|x_n\|$  — сходится. Тогда  $\forall \varepsilon > 0 \exists N \forall m, n \geq N: \sum_{k=m+1}^n \|x_k\| < \varepsilon$ . Воспользуемся свойством о том, что сумма норм не меньше, чем норма суммы. А значит получили  $\forall \varepsilon > 0 \exists N \forall m, n \geq N: \left\| \sum_{k=m+1}^n x_k \right\| < \varepsilon$ , что является критерием Коши для исходной последовательности. □

- Теорема 3.4.** 1.  $X$  — нормированное пространство. Если  $\lim x_n = 0$  и в каждой скобке  $\leq M$  слагаемых то из сходимости ряда после расстановки скобок следует сходимость исходного
2.  $\mathbb{R}$ . Если в каждой скобке все члены одного знака, то из сходимости ряда после расстановки скобок следует сходимость исходного.

**Доказательство.**  $S_n := \sum_{k=1}^n x_k$  и  $S_{n_k} \rightarrow S$ .

1. Возьмем  $n$ :  $n_k \leq n < n_{k+1}$ .  $S_n = S_{n_k} + x_{n_k+1} + x_{n_k+2} + \dots + x_n$ .  $\|S_n - S\| \leq \|S_{n_k} - S\| + \|x_{n_k+1}\| + \dots + \|x_n\|$ . Мы знаем, что  $S_{n_k} \rightarrow S \implies \exists K \forall k \geq K: \|S_{n_k} - S\| < \varepsilon$ .  
 $\lim x_j = 0 \implies \exists N \forall j \geq N: \|x_j\| < \varepsilon$ . Следовательно исходная сумма не более  $(M+1)S$ .
2.  $n_k \leq n < n_{k+1}$ . Пусть в этом блоке неотрицательные слагаемые.  $S_n = S_{n_k} + x_{n_k+1} + x_{n_k+2} + \dots + x_n \geq S_{n_k}$ . А еще знаем, что  $S_n = S_{n_{k+1}} - x_{n_k+1} - x_{n_k+1-1} - \dots - x_{n+1} \leq S_{n_{k+1}}$ . Откуда получаем, что  $S_{n_k} \leq S_n \leq S_{n_{k+1}}$ .

□

### 3.2. Знакопостоянные ряды

**Теорема 3.5.** Пусть  $a_n \geq 0$ .

Тогда сходимость ряда  $\sum_{n=1}^{\infty} a_n$  равносильная ограниченности последовательности  $S_n = \sum_{k=1}^n a_k$ .

**Доказательство.**  $S_1 \leq S_2 \leq \dots$ . Монотонная возрастающая последовательность имеет предел  $\iff$  она ограничена. □

**Теорема 3.6** (Признак сравнения). Пусть  $0 \leq a_n \leq b_n$ . Тогда

1. Если  $\sum_{n=1}^{\infty} b_n$  сходится, то  $\sum_{n=1}^{\infty} a_n$  — сходится.
2. Если  $\sum_{n=1}^{\infty} a_n$  — расходится.

**Доказательство.** 1.  $A_n := \sum_{k=1}^n a_k \leq \sum_{k=1}^n b_k = B_n$ .

$\sum b_n$  — сходится  $\implies B_n$  — ограничена  $\implies A_n$  ограничена  $\implies \sum a_n$  сходится.

2. Отрицание 1.

□

**Следствие.** 1. Пусть  $a_n, b_n \geq 0$ . Если  $a_n = \mathcal{O}(b_n)$  и  $\sum_{n=1}^{\infty} b_n$  — сходится, то  $\sum_{n=1}^{\infty} a_n$  — сходится.

2. Пусть  $a_n, b_n \geq 0$ , Если  $a_n \sim b_n$ , то ряды ведут себя одинаково.

**Доказательство.** 1.  $a_n = \mathcal{O}(b_n) \implies 0 \leq a_n \leq Cb_n$ .  $\sum_{n=1}^{\infty} Cb_n = C \sum_{n=1}^{\infty} b_n$  — сходится  $\implies \sum a_n$  — сходится.

2.  $a_n = b_n c_n$ , где  $\lim c_n = 1 \implies \frac{1}{2} \leq c_n \leq 2$  при  $n \geq N$ . Тогда  $a_n = \mathcal{O}(b_n)$  и  $b_n = \mathcal{O}(a_n)$ .

□



**Теорема 3.7** (Признак Коши). Пусть  $a_n \geq 0$ .

1. Если  $\sqrt[n]{a_n} \leq q < 1$ , то ряд сходится.
2.  $\sqrt[n]{a_n} > 1$ , то ряд расходится.
3. Пусть  $\overline{\lim} \sqrt[n]{a_n} = q^*$ . Если  $q^* > 1$ , то ряд расходится, если  $q^* < 1$ , то ряд сходится.

**Замечание.** Если  $q^* = 1$ , то ряд может сходиться, а может расходиться.  $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n(n+1)}$  — сходится,  $\sqrt[n]{\frac{1}{n(n+1)}} \rightarrow 1$ .

$\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n}$  — расходится.  $\sqrt[n]{a_n} = \frac{1}{\sqrt[n]{n}} \rightarrow 1$ .

**Доказательство.** 1.  $\sqrt[n]{a_n} \leq q < 1 \implies a_n \leq q^n$ . По признаку сравнения с геометрической прогрессией  $\sum_{n=1}^{\infty} q^n$  — сходится.

2.  $\sqrt[n]{a_n} \geq 1 \implies a_n \not\rightarrow 0 \implies$  расходится.

3. Если  $q^* > 1$ . Найдется  $n_k : \sqrt[n_k]{a_{n_k}} \rightarrow q^* > 1$  (по определению верхнего предела)  $\implies$  начиная с некоторого номера  $\sqrt[n_k]{a_{n_k}} > 1 \implies a_{n_k} > 1 \implies a_n \not\rightarrow 0$  и ряд расходится.

Если  $q^* < 1$ ,  $q^* = \limsup_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n]{a_n} \implies$  для больших  $n$   $\sup_{k \geq n} \sqrt[k]{a_k} < q < 1$ . Но при этом  $\sqrt[n]{a_n} \leq \sup_{k \geq n} \sqrt[k]{a_k}$ , а значит  $\sqrt[n]{a_n} < q$  при больших  $n \implies$  ряд сходится.

□

**Теорема 3.8** (Признак Даламбера). Пусть  $a_n > 0$ . Тогда

1.  $\frac{a_{n+1}}{a_n} \leq d < 1$ , то ряд сходится.
2. Если  $\frac{a_{n+1}}{a_n} \geq 1$ , то ряд расходится.
3. Пусть  $\lim \frac{a_{n+1}}{a_n} = d^*$ . Если  $d^* < 1$ , то ряд сходится. Если  $d^* > 1$ , то ряд расходится.

**Замечание.** С единицей все еще ничего непонятно. Смотри предыдущие примеры.

**Доказательство.** 1.  $\frac{a_n}{a_1} = \frac{a_n}{a_{n-1}} \cdot \frac{a_{n-1}}{a_{n-2}} \cdot \dots \cdot \frac{a_2}{a_1} \leq d^{n-1}$ .  $a_n \leq d^{n-1} \cdot a_1$  и ряд мажорируется геометрической прогрессией  $\sum_{n=1}^{\infty} a_1 \cdot d^{n-1}$ . Она сходится  $\implies \sum_{n=1}^{\infty} a_n$  — сходится.

2.  $a_{n+1} \geq a_n \implies a_n \geq a_1 > 0$  и  $a_n \not\rightarrow 0 \implies$  ряд расходится.

3. Если  $d^* > 1$ . Тогда  $\frac{a_{n+1}}{a_n} \geq 1$  при  $n \geq N \implies a_n \geq a_N > 0 \quad \forall n \geq N \implies a_n \not\rightarrow 0$  и ряд расходится.

Если  $d^* < 1$ . Так как  $\lim \frac{a_{n+1}}{a_n} = d^* \implies \frac{a_{n+1}}{a_n} < d$  при  $n \geq N \implies$  ряд сходится по признаку 1.

□

**Пример.**  $\sum_{n=0}^{\infty} \frac{x^n}{n!}$ .

Даламбер.  $\frac{a_{n+1}}{a_n} = \frac{x^{n+1}}{(n+1)!} : \frac{x^n}{n!} = \frac{x}{n+1} \rightarrow 0 < 1$ . Ряд сходится.

Коши.  $\sqrt[n]{a_n} = \sqrt[n]{\frac{x^n}{n!}} = \frac{x}{\sqrt[n]{n!}} \sim \frac{x}{\sqrt[n]{n^n e^{-n} \sqrt{2\pi n}}} = \frac{x}{n e^{-1} \sqrt[n]{2\pi n}} \sim \frac{x e}{n} \rightarrow 0$ .

**Теорема 3.9.** Пусть  $a_n > 0$  и  $\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{a_{n+1}}{a_n} = d^*$ . Тогда  $\lim \sqrt[n]{a_n} = d^*$ .

**Доказательство.**  $\lim \frac{a_{n+1}}{a_n} = d^* \implies \lim \frac{\ln a_{n+1} - \ln a_n}{(n+1) - n} = \ln d^* \xrightarrow{\text{т. Штольца}} \lim \frac{\ln a_n}{n} = \ln d^* \implies \sqrt[n]{a_n} = d^*.$   $\square$

**Теорема 3.10.** Пусть  $f$  неотрицательная монотонная:  $[1, +\infty) \rightarrow \mathbb{R}$ . Тогда:

$$\left| \sum_{k=a}^b f(k) - \int_a^b f(x) dx \right| \leq \max\{f(a), f(b)\}.$$

**Доказательство.** Картинка :(

$$\sum_{k=a}^{b-1} f(k) \geq \int_a^b f(x) dx \geq \sum_{k=a+1}^b f(k).$$

TODO.  $\square$

**Теорема 3.11** (интегральный признак сходимости ряда). Пусть  $f: [1, +\infty) \rightarrow \mathbb{R}$  неотрицательная, монотонно убывающая.

Тогда  $\sum_{n=1}^{\infty} f(n)$  и  $\int_1^{\infty} f(x) dx$  ведут себя одинаково.

**Доказательство.** По предыдущей теореме  $S_n := \sum_{k=1}^n f(k) \geq \int_1^n f(x) dx \geq \sum_{k=2}^n f(k) = S_n - f(1)$ .

Если ряд сходится, то  $S_n$  — ограничена  $\implies \int_1^n f(x) dx \implies F(x) = \lim_1^x f$  — ограничена.

Если  $\int$  сходится  $\implies \int_1^n f$  — ограничена  $\implies S_n$  — ограничена  $\implies$  ряд расходится.  $\square$

**Пример.** 1.  $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^p}$ ,  $p > 0$  (иначе члены ряда  $\not\rightarrow 0$  и ряд расходится).

$f(x) = \frac{1}{x^p}$ . Монотонно убывает.  $\sum \frac{1}{n^p}$  и  $\int_1^{\infty} \frac{dx}{x^p}$  ведут себя одинаково: сходятся при  $p > 1$ .

2.  $\sum_{n=2}^{\infty} \frac{1}{n \ln n} \cdot f(x) = \frac{1}{x \ln x}$  монотонно убывает. Поэтому  $\int_2^{\infty} \frac{dx}{x \ln x}$  и  $\sum_{n=2}^{\infty} \frac{1}{n \ln n}$  ведут себя одинаково.

Там можно посчитать интеграл.

**Следствие.** 1. Если  $a_n > 0$  и  $a_n = \mathcal{O}(\frac{1}{n^p})$  при  $p > 1$ .

2. Если  $a_n > 0$  и  $a_n \sim \frac{c}{n^p}$ , то при  $p > 1$  ряд  $\sum a_n$  — сходится, а иначе расходится.