COMPLETEZZA DELL'INSIEME DEI NUMERI REALI $\mathbb R$.

FABIO CIPRIANI

1. Completezza dell'insieme dei numeri reali $\mathbb R$.

Nell'insieme dei numeri reali \mathbb{R} la condizione di Cauchy e' necessaria e sufficiente per la convergenza di successioni. Da questa proprieta' di completezza ne seguono altre tre che dimostriamo qui di seguito. La prima riguarda la convergenza di successioni monotone, la seconda l'esistenza dell'estremo superiore di sottoinsiemi di \mathbb{R} mentre la terza concerne l'esistenza di punti di accumulazione di sottoinsiemi infiniti di \mathbb{R} .

Theorem 1.1. (Convergenza di successione monotone e limitate in \mathbb{R}) Sia $\{x_n \in \mathbb{R} : n \geq 1\} \subset \mathbb{R}$ una successione monotona crescente (risp. decrescente) e superiormente (risp. inferiormente) limitata. Allora la successione e' convergente in \mathbb{R} .

Proof. Limiteremo la dimostrazione alle successioni crescenti superiormente limitate. Per la completezza di \mathbb{R} e' sufficiente mostrare che la successione possiede la proprieta' di Cauchy seguente:

$$\forall \varepsilon > 0$$
 esiste $N \ge 1$ tale che se $n, m \ge N$ allora $|x_n - x_m| < \varepsilon$.

Supponiamo, per assurdo, che la successione non sia di Cauchy. Fissato $\varepsilon > 0$ si avrebbe che

$$\forall N \geq 1$$
 esistono $n_N, m_N \geq N$ tale che $|x_{n_N} - x_{m_N}| \geq \varepsilon$.

Possiamo supporre che $m_N \leq n_N$ per ogni $N \geq 1$ di modo che, essendo la successione crescente si abbia

$$x_{n_N} - x_{m_N} = |x_{n_N} - x_{m_N}| \ge \varepsilon.$$

Per $N_1 := 1$ siano quindi $n_1 \ge m_1 \ge 1$ tali che $x_{n_1} \ge \varepsilon + x_{m_1}$,

per $N_2 := n_1$ siano quindi $n_2 \ge m_2 \ge N_2 = n_1$ tali che $x_{n_2} \ge \varepsilon + x_{m_2}$,

. . .

per $N_{k+1} := n_k$ siano quindi $n_{k+1} \ge m_{k+1} \ge N_{k+1} = n_k$ tali che $x_{n_{k+1}} \ge \varepsilon + x_{m_{k+1}}$,

. . . .

Poiche' la successione e' crescente abbiamo che $m_{k+1} \ge n_k$ implica che $x_{m_{k+1}} \ge x_{n_k}$ e di conseguenza che

$$x_{n_{k+1}} \ge \varepsilon + x_{m_{k+1}} \ge \varepsilon + x_{n_k} \ge \cdots \ge k\varepsilon + x_{n_1} \ge k\varepsilon + x_1 \quad \forall \quad k \ge 1.$$

Quindi

$$\lim_{k\to +\infty} x_{n_{k+1}} = +\infty.$$

Poiche' cio' contraddice l'ipotesi di limitatezza superiore, la successione e' necessariamente di Cauchy.

Esercizio. Mostrare che $\sqrt{2} \notin \mathbb{Q}$ cioe' che l'equazione $x^2 = 2$ non ha soluzioni razionali.

Esercizio. Mostrare che $\sqrt{3} \notin \mathbb{Q}$ cioe' che l'equazione $x^2 = 3$ non ha soluzioni razionali.

Esercizio. Sia $p \in \mathbb{P}$ un numero primo. Mostrare che $\sqrt{p} \notin \mathbb{Q}$ cioe' che l'equazione $x^2 = p$ non ha soluzioni razionali. **Suggerimento**: ogni numero naturale $m \in \mathbb{N}$ puo' essere decomposto in maniera unica come prodotto di numeri primi

$$m = p_1^{n_1} \cdots p_k^{n_k}$$
 $p_1, \dots, p_k \in \mathbb{P}$, $n_1, \dots, n_k \in \mathbb{N}$.

Example 1.2. La successione definita per ricorrenza da

$$x_1 = 2,$$
 $x_{n+1} := \frac{x_n}{2} + \frac{1}{x_n}$ $n \ge 1$,

converge al numero $\sqrt{2} \in \mathbb{R}$.

Poiche' $x_1 = 2 > 0$ per definizione e, se supponiamo $x_n > 0$, dalla relazione di ricorrenza, segue che $x_{n+1} > 0$, per il Principio di Induzione si deduce che $x_n > 0$ per $n \ge 1$ per cui la successione e' ben definita (in particolare cioe' $x_n \ne 0$ per $n \ge 1$) e inferiormente limitata.

Poiche' $x_1=2\in\mathbb{Q}$ per definizione e, se supponiamo $x_n\in\mathbb{Q}$, dalla relazione di ricorrenza, segue che $x_{n+1}\in\mathbb{Q}$, per il Principio di Induzione si deduce che $x_n\in\mathbb{Q}$ per $n\geq 1$ per cui la successione e' formata da numeri razionali.

Poiche' per ogni coppia di numeri reali $a, b \in \mathbb{R}$ si ha che $(a-b)^2 \ge 0$, ne segue la disuguaglianza $2ab \le a^2 + b^2$. La relazione di ricorrenza implica allora che per $n \ge 1$ si abbia

$$x_{n+1} = \frac{x_n}{2} + \frac{1}{x_n}$$
 \Rightarrow $2 + x_n^2 = 2x_n x_{n+1} \le x_n^2 + x_{n+1}^2$ \Rightarrow $2 \le x_{n+1}^2$.

Poiche' $x_1^2 = 4 > 2$ si ha

$$x_n^2 \ge 2 \qquad \forall \quad n \ge 1.$$

Poiche' per $n \ge 1$ si ha

$$x_n - x_{n+1} = x_n - \left(\frac{x_n}{2} + \frac{1}{x_n}\right) = \frac{x_n}{2} - \frac{1}{x_n} = \frac{x_n^2 - 2}{2x_n} \ge 0,$$

la successione e' monotona decrescente e inferiormente limitata e quindi, per il Teorema 1.1 convergente in \mathbb{R} . Sia $l := \lim_{n \to +\infty} x_n \in \mathbb{R}$ il suo limite. Infine, poiche' la relazione di ricorrenza implica che

$$l = \lim_{n \to +\infty} x_n = \lim_{n \to +\infty} x_{n+1} = \lim_{n \to +\infty} \left(\frac{x_n}{2} + \frac{1}{x_n}\right) = \frac{l}{2} + \frac{1}{l},$$

deduciamo che il numero l e' la soluzione positiva dell'equazione $l^2=2$, cioe' che $l=\sqrt{2}$.

Esercizio. Siano $k \ge 1$ intero e p > 0 fissati. Si scelga $x_1 \in \mathbb{N}$ tale che $x_1^k \ge p$ e si mostri che la successione definita per ricorrenza da

$$x_{n+1} := \frac{k-1}{k} x_n + \frac{p}{k x_n^{k-1}} \qquad n \ge 1,$$

converge al numero $p^{1/k} \in \mathbb{R}$.

Suggerimento: si usi la disuguaglianza di Bernoulli: $a^k \ge (1-k) + ka$ valida per a > 0 e $k \in \mathbb{N}$.

Definition 1.3. (Estremo superiore, estremo inferiore, massimo, minimo) Dato un insieme $A \subset \mathbb{R}$, un numero $\overline{x} \in \mathbb{R}$ e' detto **extremo superiore di** A se

• \overline{x} un maggiorante di A

$$x \in A \Rightarrow x \leq \overline{x}$$

• e se \overline{x} e' il **minimo dei maggioranti di** A nel senso che per ogni $\varepsilon > 0$, $\overline{x} - \varepsilon$ non e' un maggiorante di A, esiste cioe' $x \in A$ tale che $\overline{x} - \varepsilon < x$.

Dato un insieme $A \subset \mathbb{R}$, un numero $\overline{x} \in \mathbb{R}$ e' detto **extremo inferiore di** A se

 \bullet \overline{x} un minorante di A

$$x \in A \Rightarrow x \ge \overline{x}$$

• e se \overline{x} e' il **massimo dei minoranti di** A nel senso che per ogni $\varepsilon > 0$, $\overline{x} - \varepsilon$ non e' un minorante di A, esiste cioe' $x \in A$ tale che $\overline{x} - \varepsilon > x$.

Se esiste, l'estremo superiore (risp. inferiore) di A si indica con sup A (risp. inf A). Se l'estremo superiore (risp. inferiore) appartiene all'insieme, sup $A \in A$ (risp.inf $A \in A$), allora e' detto **massimo** (risp. **minimo**) e indicato con max A (risp. min A).

Example 1.4. Se A = (a, b) allora $\sup A = b$, $\inf A = a$ e non esistono $\max A$ e $\min A$. Se B = [a, b] allora $\sup A = \max A = b$, $\inf A = \min A = a$.

Esercizio. Determinare, se esistono, sup A, inf A, max A, min A di

$$A:=\{(-1)^{n+1}-\frac{1}{n}:n\geq 1\}\,.$$

Esercizio. Sia $A = \{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ la successione dell'Esempio 1.2. Determinare inf A.

Se un insieme A non e' superiormente (risp. inferiormente) limitato allora non esistono maggioranti (risp. minoranti) ne tantomeno esiste sup A (risp. inf A). Viceversa

Theorem 1.5. (Esistenza dell'estremo superiore per insiemi superiormente limitati) Se $A \subset \mathbb{R}$ e' superiormente limitato, allora esiste sup $A \in \mathbb{R}$.

Proof. Poiche' A e' superiormente limitato, esiste $b_0 \in \mathbb{R}$ maggiorante di A:

$$x \in A \qquad \Rightarrow \qquad x \le b_0$$

Sia $a_0 \in A$ un elemento fissato di A di modo che

$$[a_0,b_0]\cap A\neq\emptyset$$
.

Sia $c := \frac{a_0 + b_0}{2}$ il punto medio di $[a_0, b_0]$ e consideriamo i due sub-intervalli

$$[a_0, c]$$
 e $[c, b_0]$.

Evidentemente in almeno uno dei due sub-intervalli vi sono elementi di A. Ne scegliamo uno dei due, denotandolo con $[a_1,b_1]$, optando per quello di destra se entrambe le meta' contengono elementi di A. Evidentemente abbiamo che

$$[a_1,b_1]\cap A\neq\emptyset$$

e che b_1 e' un maggiorante di A:

$$x \in A \implies x < b_1$$
.

Iterando questo procedimento (detto di dicotomia) otteniamo una successione decrescente di intervalli

$$\cdots \subset [a_{n+1}, b_{n+1}] \subset [a_n, b_n] \cdots \subset [a_1, b_1] \subset [a_0, b_0]$$

tali che per ogni $n \geq 1$ si ha che b_n e' maggiorante di A

$$(1.1) n \ge 1, x \in A \Rightarrow x \le b_n$$

e che per ogni $n\geq 1$ si ha che

$$[a_n, b_n] \cap A \neq \emptyset$$
.

Poiche ' la successione $\{a_n\}$ e' crescente e superiormente limitata da b_0

$$\dots a_n \le a_{n+1} \le \dots \le b_0,$$

la successione $\{b_n\}$ e' decrescente e inferiormente limitata da a_0

$$a_0 \leq \ldots b_{n+1} \leq b_n \leq \ldots$$

e

$$\lim_{n \to +\infty} b_n - a_n = \lim_{n \to +\infty} \frac{b_0 - a_0}{2^n} = 0,$$

per il Teorema 1.1, esiste $\overline{x} \in \mathbb{R}$ limite comune delle due successioni

$$\overline{x} = \lim_{n \to +\infty} a_n = \lim_{n \to +\infty} b_n.$$

Mostriamo ora che proprio \bar{x} e' sup A. Infatti, per il teorema del confronto, passando al limite nella (1.1) abbiamo che

$$x \in A \qquad \Rightarrow \qquad x \leq \overline{x}$$

e che quindi \overline{x} e' un maggiorante di A. Se, per assurdo, non fosse $\overline{x} = \sup A$, esisterebbe $\varepsilon > 0$ per il quale $\overline{x} - \varepsilon$ sarebbe un maggiorante di A, strettamente minore di \overline{x} :

$$x \in A \qquad \Rightarrow \qquad x \leq \overline{x} - \varepsilon < \overline{x}$$
.

Ma poiche' $\overline{x} = \lim_{n \to +\infty} a_n$, esisterebbe $n \ge 1$ per cui $\overline{x} - \varepsilon < a_n < \overline{x}$. Cio' contradirebbe il fatto che, per costruzione, $[a_n, b_n] \cap A \ne \emptyset$.

Definition 1.6. (Punti di accumulazione)

Dato un insieme $E \subseteq \mathbb{R}$, un punto $\overline{x} \in \mathbb{R}$ e' detto di **accumulazione per** E se

$$\forall \varepsilon > 0 \quad (E \setminus \{\overline{x}\}) \cap (\overline{x} - \varepsilon, \overline{x} + \varepsilon) \neq \emptyset$$

cioe' se

$$\forall \varepsilon > 0 \quad \exists \ x \in E \setminus \{\overline{x}\} \quad such \ that \ |x - \overline{x}| < \varepsilon$$

cioe' se

$$\forall \varepsilon > 0 \ l'insieme \ E \cap (\overline{x} - \varepsilon, \overline{x} + \varepsilon) \ e' \ infinito \ (ha \ cioe' \ infiniti \ elementi).$$

L'insieme dei punti di accumulazione di $E \subseteq \mathbb{R}$ e' detto insieme derivato di E e si denota con \mathbf{E}' .

Dato un insieme A, indicheremo con il simbolo $\sharp(\mathbf{A}) = \infty$ il fatto che abbia infiniti elementi (cioe' che non sia un insieme finito).

Theorem 1.7. (Proprieta' di Bolzano-Weierstrass.)

 $Sia\ E\subset\mathbb{R}$ un insieme limitato e infinito. L'insieme dei punti di accumulazione E' di E e' allora non vuoto:

$$E' \neq \emptyset$$
.

Proof. Poiche' E e' limitato, esiste un intervallo limitato $[a_0,b_0] \subset \mathbb{R}$ che lo contine: $E \subseteq [a_0,b_0]$. Sia $c := \frac{a_0+b_0}{2}$ il punto medio di $[a_0,b_0]$. Evidentemente almeno uno dei due sub-intervalli

$$[a_0, c]$$
 e $[c, b_0]$

contiene infiniti punti di E. Ne scegliamo uno e lo denotiamo con $[a_1, b_1]$. Avremo che $[a_1, b_1] \cap E$ e' infinito:

$$\sharp([a_1,b_1]\cap E)=\infty.$$

Iterando questo procedimento (detto di dicotomia) otteniamo una successione decrescente di intervalli

$$\cdots \subset [a_{n+1}, b_{n+1}] \subset [a_n, b_n] \cdots \subset [a_1, b_1] \subset [a_0, b_0]$$

tali che per ogni $n \ge 1$ si ha che

$$\sharp([a_n,b_n]\cap E)=\infty.$$

Poiche' la successione $\{a_n\}$ e' crescente e superiormente limitata da b_0

$$\dots a_n \le a_{n+1} \le \dots \le b_0,$$

la successione $\{b_n\}$ e' decrescente e inferiormente limitata da a_0

$$a_0 \leq \ldots b_{n+1} \leq b_n \leq \ldots$$

e

$$\lim_{n \to +\infty} b_n - a_n = \lim_{n \to +\infty} \frac{b_0 - a_0}{2^n} = 0,$$

per il Teorema 1, esiste $\overline{x} \in \mathbb{R}$ tale che

$$\overline{x} = \lim_{n \to +\infty} a_n = \lim_{n \to +\infty} b_n$$
.

Scegliendo $x_n \in [a_n, b_n] \cap E$ con $x_n \neq \overline{x}$ (cio' si puo' fare poiche' in $[a_n, b_n] \cap E$ vi sono infiniti punti ed al piu' uno solo di essi puo' coincidere con \overline{x}), otteniamo una successione $\{x_n\} \subseteq E \setminus \{\overline{x}\}$ tale che

$$a_n \le x_n \le b_n \qquad n \ge 1$$
.

Per il teorema del confronto (per limiti di successioni) abbiamo che $\overline{x} = \lim_{n \to \infty} x_n$ e che quindi $\overline{x} \in E'$. \square

PROPRIETA' DELLE FUNZIONI CONTINUE.

FABIO CIPRIANI

1. Proprieta' fondamentali delle funzioni continue

Dimostriamo qui di seguito tre proprieta' fondamentali delle funzioni continue.

Theorem 1.1. (Weierstrass: esistenza di estremi globali)

Sia $f \in C([a,b])$ una funzione continua sull'intervallo chiuso e limitato $[a,b] \subset \mathbb{R}$. Esistono allora il massimo e minimo globali di f su [a,b]. Piu' precisamente:

$$\exists x_m, x_M \in [a, b]$$
 tale che $x \in [a, b]$ \Rightarrow $f(x_m) \le f(x) \le f(x_M)$.

In altre parole, $M := f(x_M)$ e' il valore massimo e $m := f(x_m)$ il valore minimo di f su [a, b].

Proof. Ci limiteremo a provare l'esistenza del massimo. Sia $M := \sup \operatorname{Im}(f) \in \mathbb{R} \cup \{+\infty\}$ l'estremo superiore dell'immagine della funzione. Per le proprieta' dell'estremo superiore, esiste una successione $\{y_n\} \subset \operatorname{Im}(f)$ tale che $\lim_n y_n = M$. Sia quindi $\{x_n\} \subset [a,b]$ una successione tale che $f(x_n) = y_n$ per la quale, evidentemente, si ha

$$\lim_{n} f(x_n) = \lim_{n} y_n = M.$$

Se per un certo n si ha $y_n = M$ allora $M \in \text{Im}(f)$ e' un valore massimo per la funzione (e $x_n \in [a,b]$ e' il punto di massimo). Se invece $y_n \neq M$ per ogni n, allora la successione $\{x_n\}$ e' un insieme limitato e infinito e, per il Teorema di Bolzano-Weierstrass, ammette almeno un punto di accumulazione che denotiamo con $x_M \in [a,b]$. Esistera' quindi almeno una sotto-successione $\{x_{n_k}\} \subseteq \{x_n\}$ convergente a x_M : $\lim_k x_{n_k} = x_M$. Poiche' f e' continua

$$M = \lim_{n \to \infty} y_n = \lim_{n \to \infty} f(x_n) = \lim_{k \to \infty} f(x_{n_k}) = f(x_M) \in \mathbb{R}.$$

Questo dimostra che $M := \sup \operatorname{Im}(f) \in \mathbb{R}$ e' finito e che appartiene a all'imagine $\operatorname{Im}(f)$: M e' quindi un valore massimo di $\operatorname{Im}(f)$ (cioe' di f), assunto da f nel punto $x_M \in [a,b]$ (punto di massimo).

Theorem 1.2. (Proprieta' degli zeri di funzioni continue)

Sia data una funzione continua $f \in C([a,b])$ sull'intervallo chiuso e limitato $[a,b] \subset \mathbb{R}$. Se

$$f(a) \cdot f(b) < 0$$

(cioe' f assume valori di segno opposto agli estremi [a,b]) allora

$$\exists x_0 \in (a, b)$$
 tale che $f(x_0) = 0$.

Proof. Per comodita' di notazione poniamo $a_0 := a$ e $b_0 := b$. Sia $c := \frac{a_0 + b_0}{2}$ il punto medio di $[a_0, b_0]$. Se f(c) = 0 abbiamo trovato il punto $x_0 := c$ dove f si annulla. Altrimenti, tra $[a_0, c]$ e $[c, b_0]$, denotiamo con $[a_1, b_1]$ quello ai cui estremi f assume segno opposto. Iterando questo procedimento (dicotomia) otteniamo una successione decrescente di intervalli

$$\cdots \subset [a_{n+1}, b_{n+1}] \subset [a_n, b_n] \cdots \subset [a_1, b_1] \subset [a_0, b_0]$$

tali che per ogni $n \geq 1$ si ha che

$$(1.1) f(a_n) \cdot f(b_n) < 0.$$

Poiche', per costruzione, la successione $\{a_n\}$ e' crescente e superiormente limitata da b_0

$$\dots a_n \le a_{n+1} \le \dots \le b_0,$$

la successione $\{b_n\}$ e', per costruzione, decrescente e inferiormente limitata da a_0

$$a_0 \leq \ldots b_{n+1} \leq b_n \leq \ldots$$

 \mathbf{e}

$$\lim_{n\to+\infty} b_n - a_n = \lim_{n\to+\infty} \frac{b_0 - a_0}{2^n} = 0,$$

per il Teorema del Limite delle Successioni Monotone Limitate

$$\exists x_0 = \lim_{n \to +\infty} a_n = \lim_{n \to +\infty} b_n \in \mathbb{R}.$$

Passando al limite nella (1.1), per il Teorema della permanenza del segno e poiche' f e' continua in x_0 si ha

$$f(x_0)^2 = f(x_0) \cdot f(x_0) = \left(\lim_{n \to \infty} f(a_n)\right) \cdot \left(\lim_{n \to \infty} f(b_n)\right) = \lim_{n \to \infty} f(a_n) \cdot f(b_n) \le 0$$

e quindi che $f(x_0) = 0$.

Theorem 1.3. (Proprieta' dei valori intermedi e immagine di una funzione continua) Sia data una funzione continua $f \in C([a,b])$ sull'intervallo chiuso e limitato $[a,b] \subset \mathbb{R}$ e siano

$$M := \max_{[a,b]} f, \qquad m := \min_{[a,b]} f$$

i suoi valori massimo e minimo su [a,b]. Allora per ogni $\lambda \in (m,M)$

$$\exists x_{\lambda} \in [a, b]$$
 tale che $f(x_{\lambda}) = \lambda$.

In particolare l'immagine di una funzione continua f su di un intervallo chiuso [a,b] e' l'intervallo chiuso [m,M] compreso tra il valore minimo e massimo assoluti:

$$\operatorname{Im}(f) := f([a, b]) := \{ f(x) \in \mathbb{R} : x \in [a, b] \} = [m, M].$$

Proof. Siano x_m un punto di minimo e x_M un punto di massimo di f su [a,b]. Possiamo limitarci al caso $x_m < x_M$. La conclusione del teorema discende allora applicando il Teorema degli Zeri alla funzione continua $g \in C([x_m, x_M])$ definita da $g(x) := f(x) - \lambda$ sull'intervallo chiuso $[x_m, x_M]$.

Example 1.4. Mostrare che l'equazione $e^x = 1 + 2x$ ha almeno una soluzione nell'intervallo (1,3). **Svolgimento**. Consideriamo la funzione $f:[1,3] \to \mathbb{R}$ definita da $f(x:=e^x-1-2x)$. La funzione e' continua in quanto composta di funzioni continue (esponenziale, polinomi): $f \in C([1,3])$. Poiche' f(1) = e - 3 < 0 e $f(3) = e^3 - 7 > 2^3 - 7 = 1 > 0$, il Teorema degli zeri implica che esiste $x_0 \in (1,3)$ tale che $f(x_0) = 0$ e quindi che $e^{x_0} = 1 + 2x_0$.

Example 1.5. Mostrare che l'equazione $x^3 + 12 = 3x^2 + 4x$ ha ha esattamente tre soluzioni in \mathbb{R} . **Svolgimento**. Poiche' le soluzioni coincidono con gli zeri del polinomio di terzo grado $f(x) := x^3 - 3x^2 - 4x + 12$, il loro numero non puo' superare tre. Notiamo che f, in quanto polinomio, e' una funzione continua su \mathbb{R} . Poiche'

$$f(-3) = -30 < 0$$
, $f(0) = +12 > 0$, $f(+\frac{5}{2}) = -\frac{9}{8} < 0$, $f(+5) = +42 > 0$,

applicando ripetutamente il Teorema degli zeri alla funzione f sugli intervalli $[-3,0],[0,+\frac{5}{2}],[+\frac{5}{2},+5]$ otteniamo l'esistenza di tre zeri $x_1 \in [-3,0], \ x_2 \in [0,+\frac{5}{2}], \ x_3 \in [+\frac{5}{2},5].$