

实分析 笔记

任云玮

目录

1	集合论导引	2
2	测度论导引	3
3	\mathbb{R}^n 上的 Lebesgue 测度	4
3.1	方块的测度	4
3.2	ε^n 的测度	4
3.3	外测度	4
3.4	Lebesgue 测度	4
3.5	广义测度	5
3.6	Borel σ - 代数	6
3.7	Borel 正则性	6

1 集合论导引

1 定理 所有 \mathbb{R}^n 中的开集 \mathcal{O} 都可以写作可数个几乎不相交的闭方块的并的形式.

2 命题 (对称差)

1. $(A_1 \cup A_2) \Delta (B_1 \cup B_2) \subset (A_1 \Delta B_1) \cup (A_2 \Delta B_2).$

2. TODO

2 测度论导引

3 \mathbb{R}^n 上的 Lebesgue 测度

3.1 方块的测度

3.2 ε^n 的测度

3.3 外测度

3 引理 对于任意的 $A_1, A_2 \in \mathcal{M}^*(\mathbb{R}^n)$, 成立 $|\mu^*A_1 - \mu^*A_2| \leq \mu^*(A_1 \Delta A_2)$.

3.4 Lebesgue 测度

4 定义 (Lebesgue 测度) 称集合 $A \in \mathcal{M}^*(\mathbb{R}^n)$ 为 Lebesgue 可测, 若对任意 $\varepsilon > 0$, 存在初等集 B , 使得

$$\mu^*(A \Delta B) < \varepsilon. \quad (1)$$

记 Lebesgue 可测的集合全体为 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$. 定义 μ 为 μ^* 限制在 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$ 上的函数, 称其为 Lebesgue 测度.

评注 之所以既需要外测度也需要定义 Lebesgue 测度是因为虽然外测度是定义在所有集合上的, 但是它不满足可加性; 而 Lebesgue 虽然有诸如可加性等很好的性质, 但它只是定义在 \mathbb{R}^n 的一个子集上面. 而如此定义可测的原因在于, 对于初等集而言, 外测度的性质是良好且直观的.

5 命题 (Lebesgue 测度的性质) Lebesgue 测度满足如下性质

1. 对任意 $A \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$, 成立 $\mu A \geq 0$.
2. $\varepsilon^n \subset \mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$ 且若 $A \in \varepsilon^n$, 则 $\mu A = m A$.

6 定理 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$ 为环.

证明 利用命题2即可. ■

7 推论 $\mathcal{M}([0, 1])$ 为一个代数.

8 定理 μ 在 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$ 上满足可加性.

证明 即证明, 若 $A = A_1 \cup A_2$, 则 $\mu A = \mu A_1 + \mu A_2$. 其中 $\mu A \leq \mu A_1 + \mu A_2$ 可以由外测度的性质直接推出. 下考虑另一方向, 尝试证明 $\mu A > \mu A_1 + \mu A_2 - \varepsilon$.

对于固定的 ε , 首先根据 Lebesgue 可测的定义取出基础集 B_i , 满足 $\mu^*(A_i \Delta B_i) < \varepsilon/6$, 同时可以证明 $m(B_1 \cap B_2) < \varepsilon/3$. 用 $B = B_1 \cup B_2$ 来估计 A 即可完成证明. ■

9 定理 环 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$ 上的测度 μ 是 σ -可加的.

10 定理 设 $A \in \mathcal{M}^*(\mathbb{R}^n)$ 且 $A = \bigcup_{k=1}^{\infty} A_k$, 其中 $A_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$. 则 $A \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$.

评注 注意, 对于 Lebesgue 可测集, 它的测度就是外测度.

证明 首先将 A 重写为不相交集 $A'_k = A_k \setminus \bigcup_{j=1}^{k-1} A_j$. 考虑级数 $\sum \mu A'_k$, 根据条件, 它是收敛的. 之后对于它前充分多的有限项所对应的集合的并, 它是 Lebesgue 可测的, 考虑它对应的初等集 B . 而对于剩下的集合, 它们的外测度足够小. ■

11 推论 可数个零测集的并依然是零测集.

证明 利用外测度的 σ -半可加性和定理10即可证明.

12 定义 (完备) 称定义在环 \mathcal{K} 上的测度 μ 是完备的, 若任意零测集的子集的测度也为零.

13 定理 Lebesgue 测度是完备的.

3.5 广义测度

14 定义 定义 \hat{Q}_l 为中心在原点、边长为 $2l$ 的 n 维立方体.

15 定义 (σ -可测) 称 $A \subset \mathbb{R}^n$ 广义 Lebesgue 可测或 σ -可测, 若对于任意 $l \in \mathbb{N}$, 集合 $A \cap \hat{Q}_l$ Lebesgue 可测. 同时, 对于 σ -可测的集合, 定义

$$\mu A = \lim_{l \rightarrow \infty} \mu(A \cap \hat{Q}_l). \quad (2)$$

记 σ 可测的集合全体为 $\mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$.

16 定理 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^n) \subset \mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$.

17 定理 若对于 $A \in \mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$, (2) 的极限为有限值, 则 $A \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$.

评注 这一定理表明, $\mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$ 只是 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$ 加上了原来测度为无穷的那些集合. 即对于测度有限部分, 这两种的按照不同方式定义的测度是相同的.

证明 为证明 $A \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^n)$, 只需要利用定理10, 即验证 $A \in \mathcal{M}^*(\mathbb{R}^n)$ 且 A 可以拆成可数个 Lebesgue 可测集的并的形式.

首先将利用 $\{A_l \setminus A_{l-1}\}$ 拆分 A , 可以证明它们都是 Lebesgue 可测的. 之后只需要证明 A 的外测度有限即可. 注意

$$\mu^* A \leq \sum_{l=1}^{\infty} \mu^*(A_l \setminus A_{l-1}) = \sum_{l=1}^{\infty} \mu(A_l \setminus A_{l-1}).$$

而利用级数相关知识, 可知 R.H.S 收敛于有限值. ■

18 定理 $\mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$ 是 σ -代数, 它的单位元为 \mathbb{R}^n .

19 推论 设 $X \subset \mathbb{R}^n$ 为紧集, 则 $\mathcal{M}(X)$ 为 σ -代数.

20 定理 \mathbb{R}^n 中的开集都 σ -可测.

证明 利用 $\mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$ 是 σ -代数这一事实以及定理1即可. ■

3.6 Borel σ -代数

21 定义 (Borel σ -代数) 定义 \mathbb{R}^n 上的 Borel σ -代数是由开集全体生成的 σ -代数, 即

$$\mathcal{B}(\mathbb{R}^n) = \sigma(\mathcal{T}(\mathbb{R}^n)) = \bigcap \{ \mathcal{A} \subset \mathbb{R}^n \mid \mathcal{A} \supset \mathcal{T}(\mathbb{R}^n), \text{ 且 } \mathcal{A} \text{ 为 } \sigma\text{-代数} \}.$$

其中 $\mathcal{T}(\mathbb{R}^n)$ 表示 \mathbb{R}^n 上的开集全体.

评注 这一定义表明 Borel σ -代数是最小的包含了所有开集的 σ -代数. 首先, 对 \mathcal{A} 的要求表明它是包含了所有开集的 σ -代数, 而 \bigcap 则表明它是最小的. 与此同时, 由于 σ -代数对于取补集操作封闭, 所以也可以说 Borel σ -代数是由全体闭集生成的.

22 定义 (Borel 集) 称 Borel σ -代数中的元素为 Borel 集.

23 定理 Borel 代数由 \mathbb{R}^n 中的闭方块全体 $\mathcal{K}(\mathbb{R}^n)$ 生成. 且 Borel 集 Lebesgue 可测.

评注 这一定理意味着只需要定义了方块以及方块上的测度, 那么对应的 Borel 集永远是可测的.

证明 首先考虑定理的前半部分. 根据定理1可知, $\mathcal{T}(\mathbb{R}^n) \subset \sigma(\mathcal{K}(\mathbb{R}^n))$, 从而 $\sigma(\mathcal{T}(\mathbb{R}^n)) \subset \sigma(\mathcal{K}(\mathbb{R}^n))$. 而根据定义21的评注, 可知反向也成立. 因此 $\mathcal{B}(\mathbb{R}^n) = \sigma(\mathcal{K}(\mathbb{R}^n))$.

至于可测性. 由于对于任意 $A \in \mathcal{K}(\mathbb{R}^n)$, 有 $A \in \mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$, 所以根据定理18可知 $\sigma(\mathcal{K}(\mathbb{R}^n)) \subset \mathcal{K}(\mathbb{R}^n)$. ■

3.7 Borel 正则性

正则性 如果说事物 A 是关于事物 B 正则的, 那么它的含义是 A 可以用 B 来逼近. 例如说 Lebesgue 测度是 Borel 正则的, 它表明某些集合的 Lebesgue 测度可以用 Borel 集合的测度来逼近.

24 定理 设 $A \subset \mathbb{R}^n$, 则 $\mu^*(A) = \inf\{\mu(G) \mid A \subset G, G \text{ 为开集}\}$. 若 $A \in \mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$, 则 $\mu(A) = \sup\{\mu(F) \mid F \subset A, F \text{ 为紧集}\}$.

评注 这一定理表明, 我们可以从外部用开集或者从内部用紧集逼近一个集合.

证明 首先考虑前半部分, 对于 $\mu^*(A) = \infty$ 的情况是显然的, 与此同时 $\mu^*(A) \leq \inf$ 也是如此, 所以仅需要证明 $\mu^*(A) \geq \inf$ 即可. 即证明对于任意的 ε , 都存在开集 G , 使得 $\mu^*(A) + \varepsilon \geq \mu(G)$. 考虑 L.H.S, 对于 $\mu^*(A)$, 用刚比它大一点的方块覆盖 $\{K_i\}$ 来替换代替它, 即

$$\sum_{i=0}^{\infty} \mu(K_i) \leq \mu^*(A) + \frac{\varepsilon}{2}.$$

与此同时, 对于每一个方块, 考虑它对应的刚比它大一点的开方块 \tilde{K}_i , 即

$$\mu(\tilde{K}_i) \leq \mu(K_i) + \frac{\varepsilon}{2^{i+1}}.$$

利用半可加性即可知道这些开方块的并即为所需要的 G .

而对于后半部分, $\mu(A) \geq \sup$ 仍是显然的, 下考虑 $\mu(A) \leq \sup$ 的证明. 首先对于 A 有界的情况, 可以利用前半部分构造出合适的紧集. 首先取包含 A 的紧集 H , 接着从 H 中间挖去 A . 由前半部分可知, 存在一个相应的开集 $G \supset H \setminus A$. 它直观上来看, 有一部分在 H 的外面, 另一部分在 A 的里面. 而 A 中那些不属于 G 的部分, 即 $H \setminus G$, 就是所需要的紧集.

而对于 A 无界的情况, 又分为两类. 首先是 $\mu(A) = \infty$ 的情况, 利用之前的结果可知 $\sup = \infty$. 而对于 $\mu(A) < \infty$ 的情况, 注意到当 l 充分大时, (2) 中 R.H.S 的增加就很小了, 从而仍可以化归至有限的情况. ■

25 定理 $A \in \mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$ 当且仅当对任意 $\varepsilon > 0$, 存在开集 $G \supset A$ 使成立 $\mu^*(G \setminus A) < \varepsilon$.

证明 首先假设 $A \in \mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$. 对于 $\mu(A) < \infty$ 的情况, 利用定理23证明中所构造的开集即可. 而对于 $\mu(A) = \infty$ 的情况, 只需对于 A_l 取对应开集, 再取它们的并即可.

接着假设条件成立, 证明 $A \in \mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$. 对于有限的情况, 取比 A 稍大的开集并用可数个闭方块来表示它, 最后舍掉最后那些充分小的方块即得到了所要的初等集. 只需要证明 $A_l \in \mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$ 即可, 之后利用 $\mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$ 对可数并封闭来完成证明. ■

26 定理 $A \in \mathcal{M}_\sigma(\mathbb{R}^n)$ 当且仅当对任意 $\varepsilon > 0$, 存在开集 G 和闭集 F , 满足 $F \subset A \subset G$ 且 $\mu(G \setminus F) < \varepsilon$. 若 $\mu(A) < \infty$, 则 F 的选取可以是紧集.

证明 TODO