

序言	
公理体系	
构筑	
类	
ZFC公理体系	
集合运算	
集合的运算	
基本运算	
积集	
映射	
映射的性质	
基数	
关于集环的讨论	
对称差性质	
对称差构成群	
交集构成一个含么半群	
集环	
集环定义	
集环性质	
集半环	
半环概念	
半环生成环	
$\sigma$ 代数	
$\sigma$ 环与 $\delta$ 环	
推广为集代数	
集族与映射	
习题	

## 序言

由于集合论是宽泛的领域,在实分析中我们所运用到的不过是浅薄的实分析基础.于是本章是提供给志在速成集合论以进行实分析内容方面研究的人所准备的,关于集合论方面的内容反而会比较少.

## 公理体系

在介绍集合论的任何内容之前,按照惯例,我们都需要对其公理体系进行一个阐释,本文选取的是ZFC(Zermelo-Fraenkel-Choice)公理体系并承认选择公理.

### 构筑

ZFC公理体系构筑于

- 一阶逻辑,其中具有常见的 $\wedge, \neg, \leftrightarrow, \forall, \exists$ 等逻辑连词与量词,括号 $()$ ,变元 $x, y, z, \dots$ 和等号 $=$ (视为二元谓词)等;可以判定一个公式是否合乎语言的规则,比如括号的左右配对,合规者可以称为合式公式.这套语言是形式逻辑的标准基础
- 集合论所需的二元谓词 $\in$ 和以下将列出的一套公理体系 **A.0 – A.9**.若 $x \in y$ 则称 $x$ 为 $y$ 中的元素.ZFC处理的所有对象 $x, y$ 都应理解为集合;特别地,集合的元素本身也是一个集合,而集合 $s$ 和仅含 $s$ 的集合 $\{s\}$ 是两回事

### 类

尽管ZFC公理体系并不承认类的概念,但是为了让读者更方便的理解集合论及其局限之处,我们还是介绍一下类的定义

定义(类) 令 $\varphi(u)$ 为一个性质,则 $\{u : \varphi(u)\}$ 不一定是集合(比如 $\varphi(u) : u$ 为集合),这样的对象称为类(class),特别地,不是集合的类称为真类(proper class)

显然的,每一个集合都是类,例如 $\{x : x \neq x\}$ .但是有些类不是集合,例如 $R = \{X : X \notin X\}$ 就是一个真类,至于我们为什么要定义出类这个概念,还需要追溯回Bertrand Russell(也有人叫他罗素)在1918年把一个悖论通俗化,称为理发师悖论: 一个乡村理发师,自夸无人可与之相比,宣称他当然不给自己刮脸的人刮脸,但却给所有自己不刮脸的人刮脸.一天他产生了疑问:他是否应该给自己刮脸.假如他自己不刮脸的话,则按照他声言的前一半,他就不应该给自己刮脸;但是假如他自己不刮脸的话,按照他自夸的,他又必须给自己刮脸,这个理发师陷入了逻辑的窘境.

对于上述问题,我们把"理发师"改成"集合", "给自己刮脸"改成"是一个集合",也就是说理发师悖论即一切集合所组成的集合到底是不是一个集合的问题.

看到上述问题,是不是感觉集合论的体系摇摇欲坠?但是路是死的人是活的,我们可以在一些不引起悖论的类之间进行讨论,也就是我们的集合论只考虑一些安全的类(后来的Grothendieck也提出Grothendieck宇宙的概念对于讨论的集合设立一个防火墙),这也就是Zermelo以及Fraenkel的工作.

Zermelo的计划是,只准许那些看来不大会产生矛盾的类进入集合论.例如空类(也就是我们先前所讨论过的空集),任何一个有限类,以及自然数的类,看来是安全地给定了一个安全地类,从它所形成的一些类,诸如任何一个子类,安全类的联合,以及一个安全类的所有子类所成的类,都应该是安全类.但是,他排除了求余,因为既是 $x$ 是一个安全类, $x$ 的余类,即对象的某个大宇宙中所有的非 $x$ (non- $x$ )也未必是安全的.

Abraham A. Fraenkel改进了Zermelo所发展的集合论,von Neumann又对其加以改革(在此处不进行赘述).在Zermelo-Fraenkel系统中,避免悖论的希望寄托在将对于所容许的集合的类型加以限制,而同时又足够用来作为分析的基础.

## ZFC公理体系

### A.0 存在公理(Exi) 存在一个集合

$$\exists x(x = x)$$

这条逻辑公理提醒我们,我们所遵循的逻辑有一个本体上的承诺:我们所谈论的世界不能是虚无的,它至少存在着一个事物.

### A.1外延公理(Ext) 两个有相同元素的集合相等

$$\forall X \forall Y \forall u (u \in X \leftrightarrow u \in Y) \rightarrow X = Y$$

由于 $X = Y \rightarrow \forall u (u \in X \leftrightarrow u \in Y)$ 是基本的逻辑定理,于是我们有

$$\forall u (u \in X \leftrightarrow u \in Y) \leftrightarrow X = Y$$

这个公理表明集合是由其元素决定的.

### A.2配对公理(Pai)对于任意 $a$ 和 $b$ ,存在一个集合只以 $a, b$ 为元素,即

$$\forall a \forall b \exists c \forall x (x \in c \leftrightarrow x = a \vee x = b)$$

根据我们先前所描述的外延公理不难发现对于 $c$ 有这样的集合 $c$ 是唯一的(任何满足上述公理的集合 $c$ 都相等),我们可以将其表示为 $\{a, b\}$ .

有序对 $(x, y)$ 的概念也可以使用配对公理进行描述: 我们能定义 $(x, y) := \{\{x\}, \{x, y\}\}$ 由此可以定义积集 $X \times Y := \{(x, y) : x \in X, y \in Y\}$ ;准此要领不难定义有限多个集合的积集 $X \times Y \times \dots$ .集合间的映射 $f : X \rightarrow Y$ 等同于它的图形 $\Gamma_f \subset X \times Y$ :对每个 $x \in X$ ,交集 $\Gamma_f \cap (\{x\} \times Y)$ 是一个独点集(不难发现这就意味着映射是良定义的),记作 $\{f(x)\}$

### A.3分离公理模式(Sep) 令 $\varphi(u)$ 为公式. 对任意集合 $X$ ,存在一个集合 $Y = \{u \in X : \varphi(u)\}$ :

$$\forall X \exists Y \forall u (u \in Y \leftrightarrow u \in X \wedge \varphi(u))$$

也可以写为

$$Y = \{u \in X : \varphi(u)\}$$

我们称其为分离公理模式,是因为其本质上可以代表无穷多条公理,试想,对于每一公式 $\varphi$ 都存在一条相应的分离公理.由于 $Y$ 实际上是 $X$ 的一个子集,于是有时候也叫他子集公理.然而更多时候称其为分离公理.

至于分离公理为何基于一个集合 $X$ 进行讨论呢?

我们先给出一个叫做"概括原则"(\*)的概念.给定一个性质 $\psi(x)$ ,概括原则允许我们定义集合 $Y = \{x : \psi(x)\}$ 但是这显然可以生成一些真类.于是分离公理需要一个已经存在的集合 $X$ ,利用 $\psi$ 将 $Y$ 从 $X$ 中分离出来.Zermelo指出:这条公理不同于概括原则之处就在于"它有以下限制.首要的是集合不能通过这条公理**独立地定义**,而是必须由已存在的集合中被**分离**出来"

有了分离公理模式,我们就可以进行如下操作

令 $\varphi(u)$ 为一个性质:若存在集合 $X$ 满足对于任意 $u$ , $\varphi(u)$ 蕴含着 $u \in X$ ,则 $\{u : \varphi(u)\} = \{u \in X : \varphi(u)\}$ ,根据分离公理可以得知这样的集合是存在的(任取一个集合 $X$ 即可),并且这个集合并不依赖于 $X$ (根据外延公理可以得出),即如果有 $X'$ 也满足 $\varphi(u)$ 蕴含 $u \in X'$ 则有 $\{u \in X : \varphi(u)\} = \{u \in X' : \varphi(u)\}$ 这种情况下,考虑所有满足条件的集合 $X$ 便可以得到 $x \neq x \rightarrow x \in X$ 总是真的,于是根据**A.0**可以得知至少存在一个集合.

即我们可以得到以下定义

定义(空集)  $\{x : x \neq x\}$ 是一个集合,根据外延公理可知它是唯一的(考虑 $A = \{u \in X : u \neq u\}$ 以及 $B = \{u \in Y : u \neq u\}$ 可以得到 $u \in A \leftrightarrow u \in B$ )我们将其记为 $\emptyset$ 也就是常说的空集.

由分离公理不难推导出集合的子集,真子集,交集 $\cap$ 与差集 $\setminus$ 具体的证明留给读者

**A.4并集公理(Uni)**对任意集合 $X$ ,存在集合 $Y$ 满足:  $u \in Y$ 当且仅当存在 $z \in X$ 使得 $u \in Z$ ,即

$$\forall X \exists Y \forall u (u \in Y \leftrightarrow \exists z (z \in X \wedge u \in z))$$

这样的 $Y$ 是唯一的,称为 $X$ 的并,记为 $\bigcup X$ .特别地,我们定义 $X \cup Y = \bigcup \{X, Y\}$

既然在**A.3**中我们已然可以定义出集合的子集与真子集,接下来我们可以考虑一个集合所有子集构成的类,对于这个类,我们认为一个集合的所有子集组成一个新的集合.

**A.5幂集公理(Pow)** 对于任意集合 $X$ ,存在集合 $Y$ 满足 $u \in Y$ 当且仅当 $u \subset X$ ,即

$$\forall X \exists Y \forall u (u \in Y \leftrightarrow u \subseteq X)$$

由外延公理也可以得知这样的集合 $Y$ 是唯一的,我们将其称为 $X$ 的幂集(Power Set),记为 $\mathcal{P}(X)$ 有些文献中也直接记为 $P(X)$ 或 $2^X$ (至于为什么是 $2^X$ 则需要根据序数的定义进行说明,由于本章预计不会涉及到序数,于是在此进行介绍:考虑 $X \rightarrow 2 = \{0, 1\}$ ,我们将所有对应到1的元素取出,利用分离公理模式可以得到其为集合 $X$ 的一个子集,考虑所有这样的映射,构成一个集合,其即为集合 $X$ 的幂集 $\mathcal{P}(X)$ ,不难发现 $|\mathcal{P}(X)| = 2^{|X|}$ )

接下来我们可以定义集合的后继

定义:对于任意集合 $x$ ,集合 $x \cup \{x\}$ 称为 $x$ 的后继,一般即为 $S(x)$ 或者 $x^+$

**A.6(Inf)**存在集合 $X$ , $\emptyset \in X$ ,并且对任意 $x \in X$ , $x$ 的后继 $S(x)$ 也属于 $X$

$$\exists X [\emptyset \in X \wedge \forall x (x \in X \rightarrow S(x) \in X)]$$

不难看出, $\{0, 1, 2, 3, \dots\} \subseteq \omega$ ,所以无穷公理是一个集合.

这样的 $X$ 称为归纳集,预设归纳集存在的用意在于萃取它的子集

$$\{\emptyset, \{\emptyset\}, \{\emptyset, \{\emptyset\}\}, \{\emptyset, \{\emptyset\}, \{\emptyset, \{\emptyset\}\}\}, \dots\}$$

不难看出 $\{0, 1, 2, 3, \dots\} \subseteq \omega$ ,所以无穷公理保证了它是一个集合.

**A.7**替换公理模式(Rep)给定公式 $\psi(x, y)$ ,并且对任意 $x$ 有唯一的 $y$ 使得 $\psi(x, y)$ 成立.则对任意集合 $A$ ,以下集合存在

$$B = \{y : \exists x(x \in A \wedge \psi(x, y))\}$$

用公式表示就是

$$\forall A \forall x \in A \exists! y \psi(x, y) \rightarrow \exists B \forall x \in A \exists y \in B \psi(x, y)$$

首先注意到对每一公式 $\psi$ ,都有一个相应的替换公理,因此与分离公理模式一样,替换公理模式代表了无穷多条公理.其次,公式 $\forall x \in A \exists! y \psi(x, y)$ 实际上是说 $\psi$ 表示的性质是一个函数,于是替换公理模式是说,任何集合在一个函数下的像仍然是一个集合.因为这个像的元素个数不会比原像个数多.所以它不会是一个更大的集合,一般来说引起麻烦的集合都是"大"的集合,于是替换公理模式是安全的.

**A.8**正则公理(Fnd)对任意集合 $x \neq \emptyset$ ,存在 $y \in x$ 使得 $y \cap x = \emptyset$

$$\forall x(x \neq \emptyset \rightarrow \exists y(y \in x \wedge x \cap y = \emptyset))$$

正则公理,它实际上断定的是:对任意非空集合 $x$ , $x$ 中总有一个元素 $y$ 是关系 $\in$ 限制在 $x$ 上的"最小元".也就是说, $x$ 中再也没有元素属于 $y$ 了.

可以得到一个直接的推论

我们假设 $x \in x$ ,令 $\mathcal{I} = \{x\}$ ,则对 $\mathcal{I}$ 的任意元素,事实上 $\mathcal{I}$ 只有一个元素, $x$ ,都有 $x \cap \mathcal{I} = x \neq \emptyset$ 于是可以得知任意集合 $x$ 都不属于自身.

于是不会存在无穷的从属链 $x \ni x_1 \ni x_2 \ni \dots$ .

可以根据正则公理建立集合的层垒谱系(过于复杂,本章不讲)

**A.9**选择公理(AC)设集合 $X$ 的每个元素皆非空,则存在函数 $g : X \rightarrow \bigcup X$ 使得 $\forall x \in X, g(x) \in x$ (称为选择函数)

选择公理中的 $X$ 应该设想为一族非空集,选择函数 $g(x) \in x$ 意味着从每个集合 $x \in X$ 中挑出一个元素.

## 集合运算

### 集合的运算

#### 基本运算

交:  $A \cap B := \{x : x \in A \wedge x \in B\}$ ( $\wedge$ 代表与条件)

并:  $A \cup B := \{x : x \in A \vee x \in B\}$

差:  $A \setminus B := \{x : x \in A \wedge x \notin B\}$

对称差:  $A \Delta B = (A \cup B) \setminus (A \cap B)$

并和交可以推广到一般的情形

$$\begin{aligned} \bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha &= \{x : \text{有 } \alpha \in I, \text{ 使 } x \in A_\alpha\} \\ \bigcap_{\alpha \in I} A_\alpha &= \{x : \text{对一切 } \alpha \in I, \text{ 有 } x \in A_\alpha\} \end{aligned}$$

其中 $\alpha$ 是集合的指标,它在某个固定的指标集 $I$ 中变化.

若 $S \supset B$ ,则称差 $S \setminus B$ 为 $B$ 关于 $S$ 的余集.若包含集 $S$ 已经清楚地指明或由上下文可以理解时,就简称 $S \setminus B$ 为 $B$ 的余集,记作 $B^c$ .

## 积集

在实分析中积集并不需要像代数一样的严格定义

代数对于笛卡尔积的定义:

定义(Cartesian积)令 $\{A_i : i \in I\}$ 是一族以 $I$ 为指标集的非空集合. $A_i$ 的笛卡尔积是一个由所有的 $i \in I$ 满足 $f(i) \in A_i$ 的 $f : I \rightarrow \bigcup_{i \in I} A_i$ 构成的集合.将其记作 $\prod_{i \in I} A_i$

实分析中则不需要这么严谨的定义积集,一般直接将一切有序偶 $(a, b)$ (其中 $a \in A, b \in B$ )所成的集合称为 $A$ 与 $B$ 的直积或者Cartesian积,记为 $A \times B$ .类似两个集的直积,可以定义多个集的直积.

## 映射

设 $A$ 与 $B$ 都是非空集.若按照一定法则 $f$ ,对于 $A$ 中每个元 $x$ ,都存在 $B$ 中一个确定的元 $y$ 与 $x$ 相对应,则称 $f$ 为定义在 $A$ 上取值于 $B$ 中的一个函数或映射,记作 $y = f(x)$ . $y$ 称为 $x$ 在映射 $f$ 之下的像,对于固定的 $y$ , $A$ 中满足 $y = f(x)$ 的所有 $x$ 全体称为 $y$ 的原像(使用分离公理模式可以保证成立).集 $A$ 称为 $f$ 的定义域(domain),集 $B$ 称为 $f$ 的值域(image),记作 $R(f)$ (在映射中也经常记为 $\text{Im}(f)$ ).若 $A$ 是空集 $\emptyset$ ,我们就规定 $f(A) = \emptyset$ .

## 映射的性质

设有映射 $f : A \rightarrow B$ .若 $f(A) = B$ ,即对于 $B$ 中的每个元 $y$ ,都存在 $A$ 中的元 $x$ 使得 $f(x) = y$ 则称 $f$ 是一个满射.

若 $f(A)$ 中每个元 $y$ 都存在一个唯一的元 $x$ 使得 $f(x) = y$ ,或者等价地对于 $A$ 中任意两个不同的元 $x_1$ 和 $x_2$ 都有 $f(x_1) \neq f(x_2)$ ,则称 $f$ 是一个内射(单射)或者——映射;若 $f$ 既是一个满射又是一个内射,也就是说对于 $B$ 中的每一个元 $y$ , $A$ 中均存在一个唯一的元 $x$ 使得 $f(x) = y$ ,则称 $f$ 是一个双射.

设映射 $f : A \rightarrow B$ 是一一的,则对于 $f(A)$ 中的每个元 $y$ 都存在 $A$ 中的唯一的元 $x$ 与之对应,这样我们就得到一个 $f(A)$ 上取值于 $A$ 中的映射,称它是 $f$ 的逆映射,记作 $f^{-1} : f(A) \rightarrow A$ .

设有映射 $f : A \rightarrow B$ 且 $B_0 \subset B$ ,则称 $A$ 中那些项在 $B_0$ 中的元的全体为 $B_0$ 在映射 $f$ 下的原像,记作

$$f^{-1}(B_0) = \{x : x \in A, \text{ 且 } f(x) \in B_0\}$$

设 $A, B$ 是两个集.若存在一个从 $A$ 到 $B$ 的双射 $f$ ,则称 $A$ 与 $B$ 是一一对应,或者说 $A$ 与 $B$ 是对等的.

## 基数

我们把互相对等的集合归于同一类,不对等的集不属于同一类,对这样的每类集予以一个记号,称这个记号为这一类集中每个集合的势(在代数中称为基数).集合 $A$ 的势记为 $|A|$ .于是互相对等的集合具有相同的势,即 $|A| = |B|$

若集合 $A$ 与 $B$ 不对等,但集合 $B$ 对等于集合 $A$ 的某个子集,则称 $A$ 的势大于 $B$ 的势,或 $B$ 的势小于 $A$ 的势,记为 $|A| > |B|$ 或 $|B| < |A|$ .

凡是与自然数集对等的集合称为可数集,这时我们认为其基数为 $\aleph_0$ (叫做阿列夫-0)

## 关于集环的讨论

### 对称差性质

于是对于对称差运算,有:

$$A \Delta B = (A \cup B) - (A \cap B) = (B \cup A) - (B \cap A) = B \Delta A$$

于是有对称差运算满足交换律.

$$\begin{aligned}
A\Delta(B\Delta C) &= (A \cup (B\Delta C)) - (A \cap (B\Delta C)) \\
&= (A \cup ((B \cup C) - (B \cap C))) - (A \cap ((B \cup C) - (B \cap C))) \\
&= A \cup B \cup C - A \cup B \cap C - (A \cap B \cup C - A \cap B \cap C) \\
&= ((A \cup B) - (A \cap B)) \Delta C \\
&= (A \Delta B) \Delta C
\end{aligned}$$

于是有对称差运算满足结合律.

## 对称差构成群

于是若对于所有的 $A, B \in \mathfrak{A}$ 有 $\Delta$ 对其封闭, 即 $A \Delta B \in \mathfrak{A}$

则有其对于 $\Delta$ 构成一个半群.

那么其是否存在一个么元呢?

若 $\forall A \in \mathfrak{A}$ 有 $A \Delta e = A$ (由于对称差运算具有交换性, 于是满足右么元即可)

$$\begin{aligned}
A \Delta e &= (A \cup e) \setminus (A \cap e) = A \\
x \in A \cup e \wedge x \notin A \cap e \\
&\downarrow \\
e \cap A &= \emptyset, e \cup A = A
\end{aligned}$$

即 $e = \emptyset$ ;

于是 $\mathfrak{A}$ 对 $\Delta$ 构成了一个么半群.

接下来验证其是否能够构成一个群

$$\begin{aligned}
A \Delta A' &= (A \cup A') - (A \cap A') = \emptyset \\
&\downarrow \\
A \cup A' &= A \cap A' \Rightarrow A' = A
\end{aligned}$$

于是对称差构成一个群

## 交集构成一个含么半群

显然有并集满足结合律

于是对于 $\mathfrak{A}$ , 若其对于 $\cap$ 封闭, 则其也构成一个半群(需要证明结合律和单位元)

由于对于交集来说对于 $\mathfrak{A}$ 而言 $\bigcup_{X \in \mathfrak{A}} X$ 是其么元, 所以其构成一个含么半群, 若 $X \notin \mathfrak{A}$ , 则其只为半群.

# 集环

## 集环定义

首先回顾环的概念(出自李文威的《代数学方法——基础架构》)

定义(环): (含么)环是一组资料 $(R, +, \cdot)$ , 其中

- $(R, +)$ 是Abel群, 二元运算用加法符号记作 $(a, b) \mapsto a + b$ , 加法么元记为0, 称之为 $R$ 的加法群
- 乘法运算 $\cdot: R \times R \rightarrow R$ 简记为 $a \cdot b = ab$ 满足下述性质: 对于所有的 $a, b, c \in R$ ,
  - $a(b + c) = ab + ac, (b + c)a = ba + ca$ (分配律, 或曰双线性)
  - $a(bc) = (ab)c$ (乘法结合律)
- 存在元素 $1 \in R$ 使得对于所有的 $a \in R$ 均有 $a \cdot 1 = a = 1 \cdot a$ 称作 $R$ 的(乘法)么元

除去和么元相关的性质得到的 $(R, +, \cdot)$ 称为无么环.

于是观察 $\mathfrak{A}$ , 若我们能够证明其满足分配律, 则其成为一个环

$$\begin{aligned}
 A \cap (B \Delta C) &= A \cap ((B \cup C) \setminus (B \cap C)) \\
 &= A \cap (B \cup C) \setminus A \cap (B \cap C) \\
 &= (A \cap B) \cup (A \cap C) \setminus (A \cap B) \cap (A \cap C) \\
 &= (A \cap B) \Delta (A \cap C) \\
 (A \Delta B) \cap C &= ((A \cup B) \setminus (A \cap B)) \cap C \\
 &= A \cup B \cap C \setminus A \cap B \cap C \\
 &= (A \cap C) \cup B \setminus (A \cap C) \cap B \\
 &= (A \cap C) \cup (B \cap C) \setminus (A \cap C) \cap (B \cap C) \\
 &= (A \cap C) \Delta (B \cap C)
 \end{aligned}$$

于是 $\mathfrak{A}$ 形成一个环.

于是我们可以给出集环的概念:

集环: 其元素本身是某些集的任何集称为集族(也就是一族集合所构成的集合 $X = \{X_1, X_2, \dots\}$ ,  $X_1, X_2, \dots$ 也为集合).如果没有相反的说明, 我们研究这样的集族, 即它的任一元素都是某个固定集 $X$ 的一个子集.我们用 $\mathfrak{A}$ 来表示这个集族.对于我们来说, 一般比较感兴趣满足某些确定的封闭条件的集族.

定义1(**集环**) 设 $\mathfrak{A}$ 为非空集族, 若其满足:由 $A \in \mathfrak{A}, B \in \mathfrak{A} \Rightarrow A \Delta B \in \mathfrak{A} \wedge A \cap B \in \mathfrak{A}$ , 则称 $\mathfrak{A}$ 为环.

其构成环的证明过程前文已经叙述.

因为对于任何 $A$ 与 $B$ 均有

$$\begin{aligned}
 A \cup B &= (A \Delta B) \Delta (A \cap B) \\
 A \setminus B &= A \Delta (A \cap B)
 \end{aligned}$$

[证明]

并集运算

$$\begin{aligned}
 A \cup B &:= \{x : x \in A \vee x \in B\} \\
 (A \Delta B) \Delta (A \cap B) &= ((A \cup B) \setminus (A \cap B)) \Delta (A \cap B) \\
 &= ((A \cup B) \setminus (A \cap B)) \cup (A \cap B) \setminus ((A \cup B) \setminus (A \cap B)) \cap (A \cap B) \\
 &= (A \Delta B) \cup (A \cap B) \setminus (A \Delta B) \cap (A \cap B) \\
 &= A \cup B \setminus (A \Delta B) \cap (A \cap B) \\
 &= A \cup B \setminus \emptyset \\
 &= A \cup B
 \end{aligned}$$

差集运算

$$\begin{aligned}
 A \Delta (A \cap B) &= (A \cup (A \cap B)) \setminus (A \cap (A \cap B)) \\
 &= \{x : x \in A \cup (A \cap B) \wedge x \notin (A \cap B)\} \\
 &= \{x : x \in A \wedge x \notin B\} \\
 &= A - B
 \end{aligned}$$

由此我们证明了对于任何 $A, B$ 均有其差集和并集运算封闭与环 $\mathfrak{A}$ . $\square$

由于 $A \cap B$ 和 $A \cup B$ 可以作为一个新的 $\mathfrak{A}$ 中的集合, 于是可知环对于形如

$$C = \bigcap_{i=1}^n A_i, D = \bigcup_{i=1}^n A_i$$

的任何有限并与交都是封闭的.

由于 $A \setminus A = \emptyset$ 于是 $\emptyset \in \mathfrak{A}$ , 不难发现仅由空集组成的集族是最小的环.

设 $\mathfrak{G}$ (哥特字体的S)为集族, 如果 $E \in \mathfrak{G}$ 且对于任意 $A \in \mathfrak{G}$ , 下式

$$A \cap E = A$$

成立, 则 $E$ 叫做 $\mathfrak{G}$ 的单位.

不难发现对于 $\forall A \in \mathfrak{G}$ 有 $E \supset A$ , 即其为包含一切其他集的最大集.

对于有单位的集, 其作为一个环便是一个含么环.这种集环我们称为**集代数**.

## 集环性质

不难从集环的定义中得知以下定理

定理 1: 任何集环的交 $\mathfrak{R} = \bigcap_{\alpha} \mathfrak{R}_{\alpha}$ 是一个环

[证明]

对于 $A, B \in \bigcap_{\alpha} \mathfrak{R}_{\alpha}$ 有对于任意的 $\alpha$ ,  $A, B \in \mathfrak{R}_{\alpha}$ .

由于 $A \Delta B$ 和 $A \cap B$ 都属于 $\mathfrak{R}_{\alpha}$

于是有它们属于 $\mathfrak{R}$ , 即 $\mathfrak{R}$ 是一个环 $\square$

定理 2: 对于任何非空集族 $\mathfrak{G}$ 存在且仅存在一个环 $\mathfrak{R}(\mathfrak{G})$ , 它包含 $\mathfrak{G}$ 并且属于包含 $\mathfrak{G}$ 的任何环 $\mathfrak{K}$ (哥特字体的 $\mathfrak{K}$ )中

[证明]

环 $\mathfrak{R}(\mathfrak{G})$ 由族 $\mathfrak{G}$ 唯一确定, 于是对于族 $\mathfrak{G}$ 不妨构建一个“单位” $X := \bigcup_{A \in \mathfrak{G}} A$ , 于是对于任意的 $A \in \mathfrak{G}$ 有 $A \subset X$ , 考虑集合 $X$ 的幂集 $\mathcal{P}(X)$ , 其显然可以构成一个环, 于是可以设 $\Sigma := \{\mathfrak{R} : \mathfrak{R} \text{ 是 } \mathcal{P}(X) \text{ 的子环, 并且有 } \mathfrak{R} \supset \mathfrak{G}\}$ , 记 $\mathfrak{B} := \bigcap_{\mathfrak{R} \in \Sigma} \mathfrak{R}$ , 由定理1可知 $\mathfrak{B}$ 是一个集环并且它属于任何包含 $\mathfrak{G}$ 的 $\mathfrak{R}$ 中 $\square$

事实上, 对于任意的包含了 $\mathfrak{G}$ 的环 $\mathfrak{R}^*$ , 交 $\mathfrak{R} = \mathfrak{R}^* \cap \mathcal{P}(X)$ 是 $\Sigma$ 中的环, 从而有 $\mathfrak{G} \subset \mathfrak{R}(\mathfrak{G}) \subset \mathfrak{R} \subset \mathfrak{R}^*$ , 于是 $\mathfrak{R}(\mathfrak{G}) \subset \mathfrak{R}^*$  确实满足了极小性的要求. 这个环叫做 $\mathfrak{G}$ 上的极小环或者称其为 $\mathfrak{G}$ 生成环并将其记作 $\mathfrak{R}(\mathfrak{G})$ .

## 集半环

事实上, 在许多问题中, 例如测度论和概率论的公理系统中, 除了环的概念起着重要作用, 还有更一般的集半环的概念.

### 半环概念

定义2(**集半环**): 如果集族 $\mathfrak{G}$ 包含空集 $\emptyset$ , 它关于交是封闭的, 并且具有如下性质: 由 $\mathfrak{G}$ 中的 $A$ 和 $A_1 \subset A$ 就可以得到形如 $A = \bigcup_{k=1}^n A_k$ 的 $A$ 的表达式, 其中 $A_k$ 是 $\mathfrak{G}$ 中两两不相交的集合, 首项是给定集合 $A_1$ .则称 $\mathfrak{G}$ 为半环(semi\setminusminus ring).

对于任一组两两不相交的集合 $A_1, A_2, \dots, A_n$ 的并集是已知集合 $A$ , 我们就把这个并称为一个集合 $A$ 的有限分解式.

任一集环 $\mathfrak{R}$ 都是半环, 因为如果 $A$ 与 $A_1 \subset A$ 属于 $\mathfrak{R}$ 则成立如下分解式

$$A = A_1 \cup (A \setminus A_1)$$

由于集环 $\mathfrak{R}$ 对于差集运算封闭, 于是任一集环都是半环.

通过上述定义不难得出以下性质:



[引理1] 设集合  $A_1, A_2, \dots, A_n, A$  属于半环  $\mathfrak{G}$ , 其中集合  $A_i$  两两不相交并且包含于  $A$ , 这时, 可以把集合  $A_{n+1}, \dots, A_s \in \mathfrak{G}$  添加到一组集  $A_i (i = 1, 2, \dots, n)$  上使得集  $A$  的有限分解式为

$$A = \bigcup_{k=1}^s A_k (s \geq n)$$

[证明]

采用数学归纳法对其进行证明.

当  $n = 1$  时, 由半环的定义可知  $A = \bigcup_{k=1}^s A_k$  成立.

假定对于  $n = m - 1$  时成立, 接下来讨论对于  $n = m$  时

对于  $n = m - 1$  时有

$$A = A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_{m-1} \cup B_1 \cup \dots \cup B_q$$

并且有  $B_1, \dots, B_q \in \mathfrak{G}$ , 于是对于  $A_m \subset A$ , 记  $B_{p_1} := A_m \cap B_p \subset B_p (p = 1, 2, \dots, q)$ , 于是由半环的定义可知对于  $B_p$  有

$$B_p = \bigcup_{k=1}^{n_p} B_{p_k}$$

于是对于所有的  $B_p$  进行如上分解可得

$$A = A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_{m-1} \cup \bigcup_{p=1}^q \left( \bigcup_{k=1}^{n_p} B_{p_k} \right)$$

并且由于  $A_i$  两两不相交, 于是有  $B_{p_1} \cap A_i = \emptyset$  以及  $\bigcup_{p=1}^q B_{p_1} = A_m \cap (A - \bigcup_{i=1}^{m-1} A_i)$  右式无非就是  $A_m$  于是可以得知

$$A = A_1 \cup A_2 \cup \dots \cup A_{m-1} \cup A_m \cup \bigcup_{p=1}^q \left( \bigcup_{k=2}^{n_p} B_{p_k} \right)$$

接下来令  $A_{m+p} := \bigcup_{k=2}^{n_p} B_{p_k}$  即可得知对于  $n = m$  的情况也成立, 于是由数学归纳法知引理成立  $\square$

[引理2] 任一有限个属于半环  $\mathfrak{G}$  的一组集合  $A_1, \dots, A_n$  均可在  $\mathfrak{G}$  上找到有限个两两不相交的一组集  $B_1, \dots, B_t$ , 使得对于每一个  $A_k$  都可表为某些集合  $B_s$  的如下形式的无交并

$$A_k = \bigcup_{s \in M_k} B_s$$

[证明]

还是使用数学归纳法证明其合理性:

对于  $n = 1$  时, 取  $t = 1, B_1 = A_1$  即可

假设对于  $n = m - 1$  时成立, 接下来讨论对于  $n = m$  时

于是对于  $A_1$  到  $A_{m-1}$  都存在  $B_1, B_2, \dots, B_t$  使得

$$A_k = \bigcup_{s \in M_k} B_s$$

于是对于集合  $A_m$ , 令  $B_{s_1} := A_m \cap B_s$

由于  $B_s$  两两不相交, 于是  $B_{s_1}$  两两不相交并且包含于  $A_m$ , 于是由引理1可以得知可以添加一族集合  $B'_p \in \mathfrak{G}$  使得

$$A_m = \bigcup_{s=1}^t B_{s_1} \cup \bigcup_{p=1}^q B'_p$$

由于  $B_{s_1} \subset B_s$  于是还有

$$B_s = B_{s_1} \cup B_{s_2} \cup \dots \cup B_{s_{f_s}}, B_{s_j} \in \mathfrak{G}$$

成立, 于是由于

$$A_k = \bigcup_{s \in M_s} B_s = \bigcup_{s \in M_s} \bigcup_{j=1}^{f_s} B_{s_j}, k = 1, 2, \dots, m-1$$

于是我们可以利用交集运算(即对于相交处取交集, 然后利用引理1进行填补, 得到交集和无交的部分)构造两两不相交的 $B_{s_j}$ 和 $B'_p$ . 这样的 $B_{s_j}$ 和 $B'_p$ 恰好为我们所需要的满足引理条件的集合□

## 半环生成环

在我们先前对于集环的讨论中可以得知任一集族 $\mathfrak{G}$ 都存在一个包含 $\mathfrak{G}$ 的唯一极小环, 即 $\mathfrak{G}$ 生成环, 但是真正的去构造 $\mathfrak{R}(\mathfrak{G})$ 却很复杂, 但是在 $\mathfrak{G}$ 作为半环的前提下, 或许对其的构造会变得比较简单.

假设 $\mathfrak{G}$ 是一个半环, 取 $A$ 在半环 $\mathfrak{G}$ 上具有有限分解式

$$A = \bigcup_{k=1}^m A_k$$

这样的集合生成的族 $\mathfrak{J}$ 具有如下性质

对于 $A, B \in \mathfrak{J}$ 有

$$A = \bigcup_{i=1}^n A_i, B = \bigcup_{j=1}^m B_j$$

于是对于 $C_{ij} := A_i \cap B_j$ 由于半环对于交运算的封闭性, 有 $C_{ij} \in \mathfrak{G}$

并且由于 $C_{ij} \subset A_i, C_{ij} \subset B_j$ , 并且不难得到 $\bigcup_i C_{ij} \subset B_j, \bigcup_j C_{ij} \subset A_i$

于是由引理1可知如下分解式成立

$$\begin{aligned} A_i &= \bigcup_j C_{ij} \cup \bigcup_{k=1}^{r_i} D_{ik} \\ B_j &= \bigcup_i C_{ij} \cup \bigcup_{l=1}^{s_j} E_{jl} \end{aligned}$$

其中有 $D_{ik}, E_{jl} \in \mathfrak{G}$ . 于是不难发现对于 $A$ 有 $A \supset \bigcup_{i,j} C_{ij}, B \supset \bigcup_{i,j} C_{ij}$ 并且 $D_{ik} \cap E_{jl} = \emptyset$

于是不难发现有 $A \cap B = \bigcup_{i,j} C_{ij}$ 并且 $A \Delta B = (A \cup B) \setminus (A \cap B) = \bigcup_i \bigcup_{k=1}^{r_i} D_{ik} \cup \bigcup_j \bigcup_{l=1}^{s_j} E_{jl}$ .

于是不难得知 $A \cap B, A \Delta B \in \mathfrak{J}$

于是有 $\mathfrak{J}$ 对于交集与对称差运算封闭, 即由集环的定义可知这是一个环.

对于其他包含 $\mathfrak{G}$ 的环, 显然有其包含 $C_{ij}, D_{ik}, E_{jl} \in \mathfrak{G}$ 即其包含 $\mathfrak{J}$ .

于是有 $\mathfrak{J}$ 还是包含 $\mathfrak{G}$ 的最小环, 即其为 $\mathfrak{R}(\mathfrak{G})$

于是我们得出以下定理:

[定理3] 若 $\mathfrak{G}$ 是一个半环, 那么 $\mathfrak{R}(\mathfrak{G})$ 与在集合 $A_k \in \mathfrak{G}$ 上具有有限分解式

$$A = \bigcup_{k=1}^n A_k$$

的集合 $A$ 所组成的族 $\mathfrak{J}$ 一致.

## $\sigma$ 环与 $\delta$ 环

在测度论中, 我们经常使用到可列个集合的交与并, 但是这无论是在集环还是集代数都没有进行定义的.

于是我们扩充集环的定义使其包含交于并.

对于并集, 我们称其为 $\sigma$ 环, 其严格定义如下:

定义( $\sigma$ 环) 如果集环中包含任一序列 $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ 并且包含

$$S = \bigcup_{n=1}^{\infty} A_n$$

则称这样的集环为 $\sigma$ 环.

同理, 我们可以对于交集进行讨论, 对于交集, 我们称其为 $\delta$ 环, 其严格定义如下

定义( $\delta$ 环)如果集环中包含任一序列 $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ 并且包含

$$S = \bigcap_{n=1}^{\infty} A_n$$

则称这样的集环为 $\delta$ 环.

## 推广为集代数

不难发现对于 $\sigma$ 环和 $\delta$ 环, 其本质都是集环, 当其具备单位 $E$ 时都可以变为一个含么交换环, 即集代数, 于是具有单位的 $\sigma$ 环和 $\delta$ 环分别称为 $\sigma$ 代数和 $\delta$ 代数, 但是由于

$$\begin{aligned} \bigcup_{n=1}^{\infty} A_n &= E \setminus \bigcap_{n=1}^{\infty} (E - A_n) \\ \bigcap_{n=1}^{\infty} A_n &= E \setminus \bigcup_{n=1}^{\infty} (E - A_n) \end{aligned}$$

得知 $\sigma$ 代数与 $\delta$ 代数可以互相转化, 于是由于我们经常使用并集运算(测度就是直接由并集同态定义的)于是我们称其为 $\sigma$ 代数.

对于 $\sigma$ 代数有严格定义如下:

设 $X$ 为一非空集合, 假设有一族集合 $\mathcal{F} \subseteq \mathcal{P}(X)$ , 若 $\mathcal{F}$ 满足以下条件

- $X \in \mathcal{F}$
- $A \in \mathcal{F} \Rightarrow A^c \in \mathcal{F}$
- $A_n \in \mathcal{F}, \forall n \in \mathbb{N} \Rightarrow \bigcup_{n=1}^{\infty} A_n \in \mathcal{F}$

则称 $\mathcal{F}$ 为 $X$ 的 $\sigma$ 代数

如果有一族 $\mathcal{G}$ , 那么至少应该存在一个包含该族的 $\sigma$ 代数, 事实上, 令

$$X = \bigcup_{A \in \mathcal{G}} A$$

并且研究其幂集 $\mathfrak{B} := \mathcal{P}(X)$ 可知 $\mathfrak{B}$ 是包含 $\mathcal{G}$ 的 $\sigma$ 代数, 若 $\tilde{\mathfrak{B}}$ 是包含 $\mathcal{G}$ 的任意 $\sigma$ 代数, 而 $\tilde{X}$ 是其单位, 那么对于任一 $A \in \mathcal{G}$ 有 $A \in \tilde{X}$ 从而有 $X = \bigcup_{A \in \mathcal{G}} A \subset \tilde{X}$ , 若 $\tilde{X} = \bigcup_{A \in \mathcal{G}} A = X$ 则称 $\sigma$ 代数 $\mathfrak{B}$ (关于族 $\mathcal{G}$ )是不可约的. 换句话说, 不可约的 $\sigma$ 代数对于任何不属于任一 $A \in \mathcal{G}$ 的点都是不包含的.

[定理 4] 对于任何非空族 $\mathcal{G}$ 都存在(关于该族)不可约的 $\sigma$ 代数 $\mathfrak{B}(\mathcal{G})$ , 它包含 $\mathcal{G}$ 并且属于任何包含 $\mathcal{G}$ 的 $\sigma$ 代数中.

[证明] 考虑  $X = \bigcup_{A \in \mathfrak{G}} A$ , 有  $\mathcal{P}(X)$  显然是包含  $\mathfrak{G}$  的  $\sigma$  代数, 由此证明存在性, 接下来的步骤与定理2完全一致, 想看详细步骤可以看概率论笔记中概率空间部分的证明.

## 集族与映射

设  $y = f(x)$  是在集合  $M$  下定义的且在集合  $N$  中进行取值的函数(测度就是一个这样的函数), 并且设  $\mathfrak{M} := \mathcal{P}(M)$  是集合  $M$  的子集所构成的集族, 我们用  $f(\mathfrak{M})$  表示所有属于  $\mathfrak{M}$  的集  $A$  的象  $f(A)$  组成的族. 此外, 设  $\mathfrak{N}$  是包含在  $N$  中的某一集族,  $f^{-1}(\mathfrak{N})$  是属于  $\mathfrak{N}$  的集  $A$  的一切原象  $f^{-1}(A)$  组成的族.

### 习题

1. 若  $\mathfrak{N}$  是环, 则  $f^{-1}(\mathfrak{N})$  也是环
2. 若  $\mathfrak{N}$  是代数, 则  $f^{-1}(\mathfrak{N})$  也是代数
3. 若  $\mathfrak{N}$  是  $\sigma$  代数, 则  $f^{-1}(\mathfrak{N})$  也是  $\sigma$  代数
4.  $\mathfrak{N}(f^{-1}(\mathfrak{N})) = f^{-1}(\mathfrak{N}(\mathfrak{N}))$
5.  $\mathfrak{B}(f^{-1}(\mathfrak{N})) = f^{-1}(\mathfrak{B}(\mathfrak{N}))$

[证明]

只证1.后面的内容同理可证

若  $\mathfrak{N}$  是环, 则其关于对称差, 交集, 差和并集封闭.

于是对于  $A, B \in \mathfrak{N}$ , 考虑  $f^{-1}(A)$  和  $f^{-1}(B)$

$$\begin{aligned}
 f^{-1}(A) \cap f^{-1}(B) &= \{f^{-1}(x) : f^{-1}(x) \in f^{-1}(A) \wedge f^{-1}(x) \in f^{-1}(B)\} \\
 x \in A \cap B &\Rightarrow x \in A \wedge x \in B \Rightarrow f^{-1}(x) \in f^{-1}(A) \wedge f^{-1}(x) \in f^{-1}(B) \\
 &\Downarrow \\
 f^{-1}(A \cap B) &\supseteq f^{-1}(A) \cap f^{-1}(B) \quad \wedge \quad f^{-1}(A \cap B) \subseteq f^{-1}(A) \cap f^{-1}(B) \\
 &\Downarrow \\
 f^{-1}(\mathfrak{N}) &\ni f^{-1}(A \cap B) = f^{-1}(A) \cap f^{-1}(B)
 \end{aligned}$$

同理证  $\Delta$  即可.