

# Introdução à Teoria dos Conjuntos - Prova 2

Ariel Serranoni Soares da Silva - Número USP: 7658024

Pedro Felizatto - Número USP: 9794531

Pietro Mesquita Piccione - Número USP: 4630640

Mateus Schmidt Mattos Lopes Pereira - Número USP: 10262892

Luís Cardoso - Número USP: 4552403

Ariel Campêlo Viana Moraes - Número USP: 9302177

8 de Agosto de 2020

## Observações iniciais

As notas de aula a seguir foram produzidas com base na Seção 3 do Capítulo 12 de [1]. A ideia do nosso trabalho é seguir fielmente o conteúdo abordado no livro, inclusive mantendo a notação e numeração que são usados pelo autor. Além disso, vamos incluir observações, soluções para os exercícios, e justificar passos que ficaram em segundo plano no tratamento feito na obra mencionada.

## 3 Árvores

Assim como fizemos anteriormente com partições, vamos agora dedicar uma seção do nosso trabalho para generalizar mais um objeto originário do contexto de combinatória finita: árvores.

**Definição 3.1.** Uma *árvore* é um conjunto ordenado  $(T, \leq)$  tal que:

- (i)  $T$  possui um menor elemento;
- (ii) para cada  $x \in T$ , o conjunto  $\{y \in T : y < x\}$  é bem ordenado sob  $\leq$ .

Os elementos de  $T$  são chamados de *nós*. Em particular, o menor elemento de  $T$  é chamado de *raiz*. Se  $x, y \in T$  são nós tais que  $y < x$ , dizemos que  $y$  é um *antecessor* de  $x$  e que  $x$  é um *sucessor* de  $y$ .

Seja  $x \in T$  um nó. A *altura*  $h(x)$  de  $x$  é o único ordinal isomorfo ao conjunto bem ordenado  $\{y \in T : y < x\}$ , composto por todos os antecessores de  $x$ . Observe que o Teorema 3.1 do Capítulo 6 garante que a altura está bem-definida como função em  $T$ . Além disso, se  $h(x)$  é um ordinal sucessor, dizemos que  $x$  é um *nó sucessor*. Caso contrário  $x$  é denominado *nó limite*. O  $\alpha$ -ésimo *nível* de  $T$  é o conjunto  $T_\alpha = \{x \in T : h(x) = \alpha\}$ . A *altura*  $h(T)$  da árvore  $T$  é o menor ordinal  $\alpha$  tal que  $T_\alpha = \emptyset$ .

Um *ramo*  $b$  de  $T$  é uma cadeia maximal em  $T$ . O *comprimento*  $\ell(b)$  de um ramo  $b$  é o tipo da ordem de  $b$ . Note que para todo ramo  $b$  de  $T$  temos  $\ell(b) \leq h(T)$ . Um ramo cujo comprimento é igual a  $h(T)$  é chamado de *cofinal*. Uma *subárvore*  $T'$  de  $T$  é um subconjunto  $T' \subseteq T$  tal que, para quaisquer  $x \in T'$  e  $y \in T$ , temos que  $y < x$  implica  $y \in T'$ . Sendo assim,  $T'$  também é uma árvore quando ordenada por  $\leq$ . Ademais, para cada  $\alpha < h(T')$  temos que o  $\alpha$ -ésimo nível de  $T'$  é dado por  $T'_\alpha = T_\alpha \cap T'$ .

Para cada  $\alpha \leq h(T)$ , o conjunto  $T^{(\alpha)} = \bigcup_{\beta < \alpha} T_\beta$  é uma subárvore de  $T$  com  $h(T^{(\alpha)}) = \alpha$ . Se  $x \in T_\alpha$  então  $\{y \in T : y < x\}$  é um ramo de  $T^{(\alpha)}$  de comprimento  $\alpha$ ; entretanto, se  $\alpha$  é um ordinal limite então  $T^{(\alpha)}$  pode ter outros ramos de comprimento  $\alpha$ .

Finalmente, um conjunto  $A \subseteq T$  é uma *anticadeia* em  $T$  se quaisquer elementos de  $A$  são incomparáveis. Isto é, se  $x, y \in A$  são tais que  $x \neq y$ , então  $x \not\leq y$  e  $y \not\leq x$ .

A respeito dos conceitos introduzidos acima, é importante observar que todo ramo ou subárvore de  $T$  contém a raiz. Também notamos que se  $x, y \in T$  são nós tais que  $y < x$ , então  $h(y) < h(x)$ . Além disso, a própria definição de  $h(T)$  nos dá que  $T_\alpha \neq \emptyset$  para todo ordinal  $\alpha < h(T)$ . A seguir, vamos resolver os exercícios sugeridos pelo autor neste ponto do texto em [1]. Tais problemas exploram algumas das propriedades que surgem imediatamente das definições que apresentamos:

**Exercício 3.1.** Seja  $(T, \leq)$  uma árvore. Mostre que:

- (i) O único elemento  $r \in T$  tal que  $h(r) = 0$  é a raiz. Em particular,  $T_0 \neq \emptyset$ ;

- (ii) Se  $\alpha, \beta$  são ordinais tais que  $\alpha \neq \beta$ , então  $T_\alpha \cap T_\beta = \emptyset$ ;
- (iii)  $T = T^{(h(T))} = \bigcup_{\alpha < h(T)} T_\alpha$ ;
- (iv) Um nó  $x \in T$  é um nó sucessor se, e somente se existe um único nó  $y \in T$  tal que

$$y < x \text{ e não existe } z \text{ tal que } y < z < x. \quad (1)$$

Se  $x$  é um nó sucessor então o nó  $y$  que satisfaz (1) é chamado de *antecessor imediato* de  $x$ , e dizemos que  $x$  é *sucessor imediato* de  $y$ . Note que cada nó sucessor possui um único antecessor imediato, mas pode possuir múltiplos sucessores imediatos;

- (v) Se  $x, y \in T$  são nós tais que  $y < x$ , então existe um único  $z \in T$  tal que  $y < z \leq x$  e  $z$  é um sucessor imediato de  $y$ ;
- (vi)  $h(T) = \sup\{\alpha + 1 : T_\alpha \neq \emptyset\} = \sup\{h(x) + 1 : x \in T\}$ .

*Solução.*

- (i) Seja  $r \in T$  tal que  $h(r) = 0$ , então temos que  $\{x \in T : x < r\} = \emptyset$ , da onde segue que  $r$  é o menor elemento de  $T$ , a raiz. Agora suponhamos  $r_1, r_2 \in T$ , de modo que  $h(r_1) = h(r_2) = 0$ . Então  $r_1$  e  $r_2$  são raízes de  $T$ . Neste caso, para todo  $x \in T$  temos que  $r_1 \leq x$ . Em particular temos que  $r_1 \leq r_2$ . Analogamente, obtemos que  $r_2 \leq r_1$ . Como  $\leq$  é uma ordem, segue que  $r_1 = r_2$ . Para  $r \in T$  raiz, temos  $h(r) = 0$  e portanto  $r \in T_0$ . Logo,  $T_0 \neq \emptyset$ .
- (ii) Suponha que existe  $x \in T_\alpha \cap T_\beta$ . Neste caso, temos que  $\alpha = h(x) = \beta$ , o que contradiz a unicidade de  $h(x)$ .
- (iii) Para a primeira igualdade, note que  $T^{(h(T))} \subseteq T$  uma vez que  $T^{(h(T))}$  é definido como uma união de subconjuntos de  $T$ . Por outro lado, seja  $x \in T$  e suponha que  $x \notin T^{(h(T))}$ . Daí, segue da definição de  $T^{(h(T))}$  que não existe  $\alpha < h(T)$  tal que  $h(x) = \alpha$ . Isso implica que  $h(x) \geq h(T)$ . Absurdo. Como a segunda igualdade segue diretamente da definição de  $T^{(h(T))}$ , a prova está completa.
- (iv) Suponha que  $x$  é um nó sucessor. Neste caso, temos por definição que  $h(x) = S(\alpha)$  para algum ordinal  $\alpha$ . Vamos mostrar que existe  $y \in T_\alpha$  tal que  $y < x$ . Assumindo o contrário, teremos que o ramo  $b := \{y \in T^{(h(x))} : y < x\}$  não possui elemento em  $T_\alpha$ . Daí, segue que

$$S(\alpha) = h(x) = \ell(b) \leq \alpha,$$

que é um absurdo. Assim, tome  $y \in T_\alpha$  tal que  $y < x$  qualquer. Se existe  $z$  tal que  $y < z < x$ , então obtemos que

$$h(y) = \alpha < h(z) < S(\alpha) = h(x),$$

absurdo. Finalmente, suponha que existem  $y_1$  e  $y_2$  distintos satisfazendo (1). Neste caso, o conjunto  $S = \{w \in T : w < x\}$  não é bem ordenado pois o subconjunto  $\{y_1, y_2\} \neq \emptyset$  de  $S$  não possui um menor elemento.

Para verificar a implicação reversa, observamos que se existe  $y$  satisfazendo (1), então  $h(x) = S(h(y))$ . Do contrário, existe  $z \in T$  tal que  $h(y) < h(z) < h(x)$ , implicando que  $y < z < x$ . Absurdo.

- (v) Vamos primeiro mostrar a existência de tal elemento  $z$ : se  $x$  é sucessor imediato de  $y$  então basta tomar  $z = x$ . Caso contrário, existe  $w$  com  $y < w < x$ . Sabendo que o conjunto  $\{t \in T : t < x\}$  é bem ordenado, concluímos que  $A = \{t \in T : y < t < x\}$ , que é não vazio pois  $w \in A$ , tem um menor elemento. Seja  $z$  o mínimo de  $A$ . Afirmamos que  $z$  é sucessor imediato de  $y$ . De fato, temos que  $y < z < x$  pois  $z \in A$ . Além disso, se  $z$  não fosse sucessor imediato de  $y$ , existiria  $w'$  com  $y < w' < z < x$ , implicando que  $w' \in A$ . Absurdo, pois  $z$  é o mínimo de  $A$ .

Para a unicidade de  $z$ , basta notar que se existem  $z_1, z_2$  satisfazendo as propriedades dadas no enunciado, então o conjunto  $\{z_1, z_2\}$  não tem um menor elemento uma vez que  $h(z_1) = h(z_2)$ . Como  $\emptyset \neq \{z_1, z_2\}$  está contido em  $\{t \in T : t < x\}$ , que é bem ordenado, temos um absurdo.

- (vi) Por definição,  $h(T)$  é o menor ordinal  $\alpha$  tal que  $T_\alpha = \emptyset$ . Sendo assim, podemos ver que

$$h(T) \geq \alpha + 1 \text{ para cada } \alpha \text{ tal que } T_\alpha \neq \emptyset,$$

e que

$$h(T) \geq h(x) + 1 \text{ para cada } x \in T.$$

Dai segue que

$$h(T) \geq \sup\{\alpha + 1 : T_\alpha \neq \emptyset\} \text{ e que } h(T) \geq \sup\{h(x) + 1 : x \in T\}.$$

Por fim, suponha que

$$h(T) > \sup\{\alpha + 1 : T_\alpha \neq \emptyset\} \text{ ou } h(T) > \sup\{h(x) + 1 : x \in T\}$$

e note que em ambos os casos, segue que  $T_\beta = \emptyset$  para algum  $\beta < h(T)$ . Absurdo.  $\square$

**Exercício 3.2.** Seja  $(T, \leq)$  uma árvore. Mostre que:

- (i) Cada cadeia em  $T$  é bem-ordenada;
- (ii) Se  $b$  é um ramo de  $T$  e  $x \in b$ , e  $y < x$ , então  $y \in b$ ;
- (iii) Se  $b$  é um ramo em  $T$ , então  $|b \cap T_\alpha| = 1$  para  $\alpha < \ell(b)$  e  $|b \cap T_\alpha| = 0$  para  $\alpha > \ell(b)$ . Conclua que  $\ell(b) \leq h(T)$ ;
- (iv)  $h(T) = \sup\{\ell(b) : b \text{ é um ramo de } T\}$ ;
- (v)  $T_\alpha$  é uma anticadeia para cada  $\alpha < h(T)$ .

*Solução.*

- (i) Seja  $C \subseteq T$  uma cadeia e seja  $\emptyset \neq S \subseteq C$ . Vamos provar que  $S$  possui um menor elemento.

Seja  $y \in S$ . Se  $y$  é o menor elemento de  $S$  então a prova está completa. Caso contrário, temos que existe  $x \in S$  tal que  $x < y$ . Assim, o conjunto  $S_y = \{z \in S : z < y\}$  é não vazio. Além disso, como  $S_y$  está contido em  $\{z \in T : z < y\}$ , que é bem ordenado por definição, obtemos que  $S_y$  possui um menor elemento  $m$ .

Por fim, vamos mostrar que  $m$  é o menor elemento de  $S$ . De fato, se  $s \in S$  então ou  $y \leq s$  ou  $s < y$ , pois  $S \subseteq C$ , que é uma cadeia. Se  $y \leq s$  então  $m < y \leq s$ . Por outro lado se  $s < y$  então  $s \in S_y$ , e assim  $m \leq s$ . De toda forma, temos que  $m \leq s$ . Logo,  $m$  é o menor elemento de  $S$ .

- (ii) Suponha que  $y \notin b$ . Vamos mostrar que  $y$  é comparável a todos os elementos de  $b$ . Se  $z \in b$  e  $z < x$ , temos que  $y$  e  $z$  são comparáveis pois ambos pertencem ao conjunto  $\{w \in T : w < x\}$ , que é bem ordenado, e em particular, linearmente ordenado. Caso  $x < z$ , obtemos que  $y < z$  por transitividade. Assim, concluímos que  $b \cup \{y\}$  é uma cadeia e portanto  $b$  não é maximal. Absurdo.
- (iii) Vamos começar mostrando que  $|b \cap T_\alpha| \leq 1$ , para cada  $\alpha$  ordinal. De fato, suponhamos por absurdo que  $|b \cap T_\alpha| \geq 2$  para algum  $\alpha$ . Tome  $x, y \in b \cap T_\alpha$  tais que  $x \neq y$ . Como  $b$  é uma cadeia, temos que  $x < y$  ou  $y < x$ . Assumindo sem perda de generalidade que  $x < y$ , segue que  $\{t \in T : t < x\} \subsetneq \{t \in T : t < y\}$  e então  $\alpha = h(x) < h(y) = \alpha$ , absurdo.

Não consegui.

Agora seja  $\alpha > \ell(b)$  e suponhamos por absurdo que  $|b \cap T_\alpha| = 1$ . Logo existe  $u \in T_\alpha$  tal que  $u \in b$ , pelo item (ii) do Exercício 3.2, segue que  $\{t \in T : t < u\} \subset b$ , donde  $h(u) \leq \ell(b)$ , mas  $u \in T_\alpha$  e então  $\alpha = h(u) \leq \ell(b)$ , impossível. Assim, como  $|b \cap T_\alpha| \leq 1$  e  $|b \cap T_\alpha| \neq 1$ , devemos ter  $|b \cap T_\alpha| = 0$ .

- (iv) Como observamos anteriormente, temos que  $\ell(b) \leq h(T)$  para todo ramo  $b$  de  $T$ . Este fato nos permite concluir que

$$h(T) \geq \sup\{\ell(b) : b \text{ é um ramo de } T\}$$

Assim nos resta verificar que  $h(T)$  é de fato o menor dos majorantes de  $\{\ell(b) : b \text{ é um ramo de } T\}$ . Isto é, vamos provar que se  $\alpha \geq \ell(b)$  para todo ramo  $b$  de  $T$ , então  $\alpha \geq h(T)$ .

De fato, como  $\alpha \geq \ell(b)$  para todo ramo  $b$  de  $T$ , segue do item anterior que  $b \cap T_\alpha = \emptyset$  para todo  $b$  ramo de  $T$ .

Como para todo nó  $x \in T$  existe um ramo  $b_x$  tal que  $x \in b_x$  e  $T_\alpha \cap b = \emptyset$  para todo ramo  $b \subseteq T$ , concluímos que  $T_\alpha = \emptyset$ . Este último fato implica que  $h(T) \leq \alpha$ , pois  $h(T)$  é o menor ordinal  $\beta$  que satisfaz  $T_\beta = \emptyset$ .

- (v) Seja  $\alpha < h(T)$  e assuma que existem  $x, y \in T_\alpha$  distintos tal que  $x$  e  $y$  são comparáveis. Suponha sem perda de generalidade que  $x < y$ . Neste caso, temos que  $x < y$  mas  $h(x) = h(y)$ . Absurdo, pois  $x < y$  implica que  $h(x) < h(y)$ .  $\square$

Agora vamos olhar para alguns exemplos de árvores:

**Exemplo 3.2.**

- (a) Todo conjunto bem-ordenado  $(W, \leq)$  é uma árvore. Sendo assim, podemos pensar em árvores como generalizações de boas ordens. A altura  $h(W)$  é o tipo de ordem de  $W$ , e o único ramo de  $W$  é o próprio  $W$ , que é cofinal.
- (b) Seja  $\lambda$  um número ordinal e seja  $A$  um conjunto não-vazio. Defina  $A^{<\lambda} = \bigcup_{\alpha < \lambda} A^\alpha$  como o conjunto de todas as seqüências transfinitas de elementos de  $A$  com comprimento menor que  $\lambda$ . Considere  $T = A^{<\lambda}$  e o ordene segundo  $\subseteq$ . Assim, para quaisquer  $f, g \in T$ , temos  $f \leq g$  se, e somente se  $f \subseteq g$ , o que significa que  $f = g|_{\text{dom}(f)}$ . É fácil verificar que  $(T, \subseteq)$  é uma árvore: Primeiro, note que a seqüência vazia é o menor elemento de  $T$ . Além disso, para cada  $f \in T$ , o conjunto  $\{x \in T : x < f\}$  é bem-ordenado pois, para qualquer um de seus subconjuntos, a seqüência de menor comprimento é o menor elemento.

Também é imediato que para cada  $f \in T$ , temos que  $h(f) = \alpha$  se, e somente se  $f \in A^\alpha$ . Isto é,  $T_\alpha = A^\alpha$ . Ademais, se  $\alpha$  e  $\beta$  são ordinais tais que  $\alpha = \beta + 1$  e  $f \in A^\alpha$ , a seqüência  $f|_\beta$  é o antecessor imediato de  $f$  e os elementos de  $f \cup \{\langle \beta, \alpha \rangle\}$  são sucessores imediatos de  $f$ .

Por fim, observemos que existe uma correspondência biunívoca entre os ramos de  $T$  e as funções de  $\lambda$  em  $A$ : se  $f \in A^\lambda$  então  $\{f|_\alpha : \alpha < \lambda\}$  é um ramo em  $T$ . Por outro lado, se  $b$  é um ramo em  $T$  então  $b$  é um sistema compatível de funções e  $f = \bigcup_{g \in b} g \in A^\lambda$ . Vale notar que todos os ramos de  $T$  são cofinais, uma vez que possuem comprimento  $\lambda = h(T)$ .

- (c) Generalizando o exemplo anterior, se  $T \subseteq A^{<\lambda}$  é uma subárvore de  $(A^{<\lambda}, \subseteq)$  com altura  $h(T) = \alpha$ , então existe uma correspondência biunívoca entre os ramos de  $T$  e as funções  $f \in A^{<\lambda} \cup A^\lambda$  satisfazendo cada uma das seguintes propriedades:

- (i)  $f|_\alpha \in T$  para todo  $\alpha \in \text{dom}(f)$ ;
- (ii)  $f \notin T$  ou  $f \in T$  e  $f$  não possui sucessores em  $T$ .

Nessa situação, costuma-se identificar um ramo utilizando sua função correspondente.

- (d) Consideremos o conjunto  $T \subseteq \mathbb{N}^{<\omega}$  das seqüências de números naturais que são finitas e decrescentes, ou seja,  $f \in T$  se, e somente se  $f(i) > f(j)$  para todo  $i < j < \text{dom}(f) \in \mathbb{N}$ . Então  $(T, \subseteq)$  é uma subárvore de  $(\mathbb{N}^{<\omega}, \subseteq)$ . Note que a altura de  $T$  é  $\omega$ . Além disso, temos pelo Exercício 2.8 do Capítulo 3 que não existe uma seqüência de números naturais que seja infinita e decrescente. Assim conseguimos concluir que todos os ramos de  $T$  são finitos, o que implica que  $T$  não possui ramos cofinais.
- (e) Seja  $(R, \leq)$  um conjunto linearmente ordenado. Uma *representação* de uma árvore  $(T, \preceq)$  *por intervalos* em  $(R, \leq)$  é uma função  $\Phi$  tal que para quaisquer  $x, y \in T$ , suas imagens  $\Phi(x)$  e  $\Phi(y)$  são intervalos em  $(R, \leq)$  satisfazendo:

- (i)  $x \preceq y$  se, e somente se  $\Phi(x) \supseteq \Phi(y)$ ;
- (ii)  $x$  e  $y$  são incomparáveis se, e somente se  $\Phi(x) \cap \Phi(y) = \emptyset$ .

Em particular, as propriedades acima implicam que  $(\Phi[T], \supseteq)$  é uma árvore isomorfa a  $(T, \preceq)$ . Por exemplo, se considerarmos a árvore  $S = \text{Seq}(\{0, 1\}) = \{0, 1\}^{<\omega}$  ordenado por  $\subseteq$ , então o sistema  $\langle D_s : s \in S \rangle$  construído no Exemplo 3.18 do Capítulo 10 é uma representação de  $(S, \subseteq)$  por intervalos fechados na reta real.

O estudo de árvores finitas é um dos principais conceitos que aparecem em combinatória. Entretanto, não vamos nos aprofundar muito no tema. Ao invés disso, vamos investigar algumas propriedades árvores infinitas, nos preocupando especialmente com condições suficientes para que uma árvore possua um ramo cofinal.

Para árvores cuja altura é um ordinal sucessor a resposta é óbvia: se  $h(T) = \alpha + 1$ , então  $T_\alpha \neq \emptyset$  e para qualquer  $x \in T_\alpha$  temos que  $y \in T : y \leq x$  é ramo cofinal de  $T$ . Assim, focaremos em árvores cuja altura é um limite. Por outro lado, o item (d) do Exemplo 3.2 nos diz que existem árvores de altura  $\omega$  que possuem apenas ramos finitos. O próximo teorema mostra que, pensando na largura de uma árvore como um majorante para a cardinalidade de seus níveis, se uma árvore  $T$  de altura enumerável é suficientemente "esguia", então  $T$  possui um ramo cofinal.

**Teorema 3.3** (Lema de König). Seja  $(T, \leq)$  uma árvore de altura  $\omega$ . Se todos os níveis de  $T$  finitos, então  $T$  admite um ramo de altura  $\omega$ .

*Demonstração.* Em primeiro lugar, observamos que se  $T$  é uma árvore, então cada nó de  $T$  possui um número finito de sucessores imediatos se, e somente se todos os níveis de  $T$  são finitos. Ancorados neste fato, vamos mostrar que se  $T$  é uma árvore de altura  $\omega$  tal que cada nó tem um número finito de sucessores imediatos, então  $T$  tem um ramo infinito. De fato, vamos utilizar recursão para construir uma sequência  $\langle c_n \rangle_{n=0}^\omega$  de nós de  $T$  tal que, para todo  $n < \omega$ , o conjunto  $\{a \in T : c_n \leq a\}$  é infinito.

Seja  $c_0$  a raiz de  $T$  e note que  $\{a \in T : c_0 \leq a\} = T$  é infinito. Além disso, se  $\{a \in T : c_n \leq a\}$  é infinito para  $n < \omega$  e consideramos o conjunto  $S_n$  dos sucessores imediatos de  $c_n$ , então

$$\{a \in T : c_n \leq a\} = \{c_n\} \cup \bigcup_{b \in S_n} \{a \in T : b \leq a\}.$$

Dáí segue que existe  $b \in S_n$  tal que o conjunto  $\{a \in T : b \leq a\}$  é infinito, assim podemos utilizar o Axioma da Escolha para tomar  $c_{n+1}$  como tal  $b$ . Finalmente, observamos que para cada  $\alpha < \omega$ , o conjunto

$$\{a \in T : a \leq c_n \text{ para algum } n < \alpha\} = \bigcup_{n < \alpha} \{a \in T : a \leq c_n\}$$

é um ramo de  $T^{(\alpha)}$  com altura  $\alpha$ . Dáí, segue por indução que

$$\{a \in T : a \leq c_n \text{ para algum } n \in \mathbb{N}\} = \bigcup_{n < \omega} \{a \in T : a \leq c_n\}$$

é um ramo de  $T^{(\omega)} = T$ . □

Apesar da prova acima conter um pouco mais de detalhe em relação àquela apresentada em [1], não fizemos a prova em mais detalhe ainda para não tirar o foco da sua ideia principal, que é construir a sequência  $\langle c_n \rangle_{n=0}^\omega$  ‘de baixo para cima’, garantindo que sempre temos mais ‘infinitos elementos’ para serem adicionados e em seguida utilizar a sequência resultante para construir um ramo ‘de cima para baixo’.

Em especial, observe que usamos o Teorema da Recursão sem explicitamente especificar uma função  $g$  para calcular  $c_{n+1}$  a partir de  $c_n$ . De fato, para consturir tal função precisamos aplicar o Axioma da Escolha: se  $k$  é uma função escolha para  $\mathcal{P}(T)$  e  $S_c$  é o conjunto de todos os sucessores imediatos de  $c$ , então definindo  $g(c, n) := k(\{b \in S_c : \{a \in T : b \leq a\} \text{ é infinita}\})$  temos que  $c_{n+1} = g(c_n, n)$ . Nesse cenário, estamos de acordo com o Teorema da Recursão que vimos. No próximo exercício veremos que, se  $T$  é uma árvore com ‘largura finita’, então  $T$  possui um ramo cofinal não importando sua altura. Nesse sentido, o resultado a seguir é uma generalização do Lema de König.

**Exercício 3.3.** Seja  $\kappa$  um cardinal infinito e seja  $(T, \leq)$  uma árvore de altura  $\kappa$ . Prove que se todos os níveis de  $T$  são finitos, então  $T$  possui um ramo de tamanho  $\kappa$ .

Ariel S.: Não manjo de topologia então não tenho condições de verificar a prova a seguir propriamente. De toda forma, me parece que a ideia seria repetir a prova do Lema de König usando recursão transfinita. Alguém manja? Ariel S.:OLHAR LINK: <https://math.stackexchange.com/q/464694/253958>

*Solução.* Para demonstrar tal resultado, iremos visualizar os ramos dessa árvore como um compacto contido num espaço topológico produto. De fato, temos que se  $X = \prod_{\alpha < \kappa} (T_\alpha \cup \{0\})$ , munido do produto das topologias discretas, então o conjunto  $C$  dos ramos da árvore é identificado como  $C = \{(x_\alpha)_{\alpha < \kappa} \in X : x_\beta < x_{\beta+1} \text{ pra todo } \beta\}$ , onde definimos  $0 > x$  pra todo  $x \in T$ .

Não é difícil ver que  $C$  é fechado, portanto como  $X$  é compacto pelo Teorema de Tychonoff,  $C$  é compacto. Agora queremos construir  $F_\lambda \subset C$  fechados encaixantes, então teremos que  $\bigcap F_\lambda \neq \emptyset$ , e assim  $x \in \bigcap F_\lambda$  será o ramo que desejamos.

Defina  $F_0 \doteq C$ . Indutivamente suponhamos  $F_\alpha$  bem definido para  $\alpha < \lambda$ , de maneira tal que  $\sup\{\ell(b) : b \in F_\alpha\} = \kappa$  (Como visto no exercício 3.2(iv)). Como todo nó possui somente finitos sucessores imediatos, temos que  $A_\lambda = (\bigcap_{\alpha < \lambda} F_\alpha) \cap T_\lambda$  é finito. Agora existe  $a_\lambda \in A_\lambda$  de modo que quando definimos

$$F_\lambda \doteq \{(x_\beta) \in C : x_\lambda = a_\lambda\} \bigcap_{\alpha < \lambda} F_\alpha$$

temos que  $\sup\{\ell(b) : b \in F_\lambda\} = \kappa$ , e não é difícil ver que  $F_\lambda$  é fechado. Então temos que existe  $x \in \bigcap F_\lambda$ , que será claramente o ramo de comprimento  $\kappa$ . □

*Solução - Mesma prova do Lema de König.* Vamos utilizar recursão transfinita para construir uma sequência  $\langle c_n \rangle_{n=0}^\kappa$  de nós de  $T$  tal que, para todo  $n < \kappa$ , o conjunto  $\{a \in T : c_n \leq a\}$  é infinito.

Em primeiro lugar, definimos  $c_0$  como a raiz de  $T$  e notamos que  $\{a \in T : c_0 \leq a\} = T$  tem cardinalidade  $\kappa$ . Além disso, se  $\alpha$  é um ordinal e construímos  $c_\alpha$ , então para definir  $c_{S(\alpha)}$  consideramos o conjunto  $S_n$  dos sucessores imediatos de  $c_n$ , então

$$\{a \in T : c_n \leq a\} = \{c_n\} \cup \bigcup_{b \in S_n} \{a \in T : b \leq a\}.$$

Daí segue que existe  $b \in S_n$  tal que o conjunto  $\{a \in T : b \leq a\}$  é infinito, assim podemos utilizar o Axioma da Escolha para tomar  $c_{n+1}$  como tal  $b$ .

Falta definir  $c_\alpha$  no caso em que  $\alpha$  é um ordinal limite: vamos considerar  $c_\alpha = \bigcup_{\beta < \alpha} c_\beta$ .

Finalmente, observamos que para cada  $\alpha < \omega$ , o conjunto

$$\{a \in T : a \leq c_n \text{ para algum } n < \alpha\} = \bigcup_{n < \alpha} \{a \in T : a \leq c_n\}$$

é um ramo de  $T^{(\alpha)}$  com altura  $\alpha$ . Daí, segue por indução que

$$\{a \in T : a \leq c_n \text{ para algum } n \in \mathbb{N}\} = \bigcup_{n < \omega} \{a \in T : a \leq c_n\}$$

é um ramo de  $T^{(\omega)} = T$ . □

Os dois últimos resultados nos mostram que para uma árvore  $(T, \leq)$  cuja altura é um ordinal limite maior ou igual a  $\omega$  com níveis finitos, então  $T$  possui um ramo cofinal. A partir deste ponto, podemos pensar em generalizações desta condição. Por exemplo, é natural que nos perguntemos se  $T$  é uma árvore de altura  $\kappa$ , onde cada nível tem cardinalidade estritamente menor de que  $\kappa$ , é verdade que  $T$  tem um ramo de comprimento  $\kappa$ ? A resposta para tal pergunta é **NÃO!**

**Definição 3.4.** Seja  $\kappa$  um cardinal não enumerável. Uma árvore de altura  $\kappa$  é uma *árvore de Aronszajn* se todos os seus níveis tem cardinalidade estritamente menor do que  $\kappa$  e se não possui ramos de comprimento  $\kappa$ .

A seguir, vamos estudar mais a fundo o caso em que  $\kappa = \omega_1$ . Nesta situação, conseguimos construir árvores de Aronszajn, que servem como contra-exemplo para a indagação que propusemos acima.

**Teorema 3.5.** Existem árvores de Aronszajn de altura  $\omega_1$ .

*Demonstração.* Vamos primeiro construir uma família  $T_\alpha$ , com  $T_0 = \{\emptyset\}$  e que para  $\alpha < \omega_1$ , temos:

- (i)  $T_\alpha \subseteq \omega^\alpha$  e  $|T_\alpha| \leq \aleph_0$ ;
- (ii) Se  $f \in T_\alpha$ , então  $f$  é injetora e  $\omega - \text{ran } f$  é infinito;
- (iii) Se  $f \in T_\alpha$  e  $\beta < \alpha$  então  $f \restriction \beta \in T_\beta$ ;
- (iv) Para qualquer  $\beta < \alpha$ , qualquer  $g \in T_\beta$ , e qualquer  $X \subseteq \omega - \text{ran } g$  finito, existe uma  $f \in T_\alpha$  tal que  $g \subseteq f$  de  $\text{ran } f \cap X = \emptyset$ .

Em primeiro lugar, observe que uma vez demonstrada a existência de uma tal família, se  $T = \bigcup_{\alpha < \omega_1} T_\alpha$ , mostraremos que  $T$  é a árvore de Aronszajn que desejamos. De fato,  $(T, <)$  é um conjunto ordenado com a contenção de funções usual.

Mostremos que  $T$  possui menor elemento. Se  $f \in T$ , então  $f \restriction 0 = \emptyset$  e temos que  $f \geq \emptyset \in T_0 \subset T$ , além disso, se  $x \in T$ , então mostremos que  $A_x \doteq \{y \in T : y < x\}$  é bem ordenado. Para facilitar a notação, considere  $o: T \rightarrow \{\alpha < \omega_1\}$  tal que  $x \in T_{o(x)}$ . Seja  $A \subset A_x$ , assim defina  $A^* \doteq \{\alpha < \omega_1 : x \in T_\alpha \cap A\}$ . Como os ordinais são bem ordenados, existe  $\beta \in A^*$  menor elemento de  $A^*$ . Logo, se  $m \in T_\beta \cap A$ , então para todo  $g \in A$ ,  $o(g) \geq \beta$ , e como  $f \restriction o(g) = g$  e  $f \restriction \beta = m$ ,  $g \restriction \beta = f \restriction \beta = m$ . Portanto  $g \geq m$  e  $m$  é o menor elemento de  $A$ .

Para verificar que  $T$  é uma árvore de Aronszajn de altura  $\omega_1$ , vejamos que, por (i), os níveis são enumeráveis. Por (iv), para todo  $\alpha < \omega_1$ ,  $T_\alpha \neq \emptyset$ , basta tomar  $\beta = 0$  e  $X$  qualquer, então  $h(T) = \omega_1$ . Precisamos verificar que  $T$  não possui ramo de comprimento  $\omega_1$ . De fato, se  $b$  fosse ramo com  $\ell(b) = \omega_1$ , se  $F = \bigcup_{f \in b} f$ , então mostraremos  $F$  é função injetora de  $\text{dom } F = \bigcup_{\alpha < \omega_1} \alpha = \omega_1$  em  $\omega$ :  $F$  é função pois se  $\langle x, p \rangle, \langle x, q \rangle \in F$ ,  $\langle x, p \rangle \in f_p \in b$  e  $\langle x, q \rangle \in f_q \in b$ . Como  $b$  é uma cadeia, temos que, sem perda de generalidade,  $f_p > f_q$ . Assim  $(f_p) \restriction o(f_q) = f_q$  então  $p = q$ . Analogamente  $F$  é injetora. Absurdo.

Seja  $T_0 = \{\emptyset\}$ . Assumindo que para todo  $\beta < \lambda$ ,  $T_\beta$  satisfaz (i)-(iv), Então, se  $\lambda$  for ordinal sucessor,  $\lambda = \alpha + 1$ , para algum  $\alpha$ , definimos

$$T_{\alpha+1} = \{g \cup \{\langle \alpha, a \rangle\} : g \in T_\alpha \text{ e } a \in \omega - \text{ran } g\}$$

Vamos verificar que  $T_{\alpha+1}$  satisfaz (i)-(iv):

- (i)  $T_{\alpha+1} \subseteq \omega^{\alpha+1}$  por construção, e  $|T_{\alpha+1}| \leq |T_\alpha| |\omega| \leq \aleph_0^2 = \aleph_0$
- (ii) Seja  $f \in T_{\alpha+1}$ , então temos  $f = g \cup \{\langle \alpha, a \rangle\}$  para alguma  $g \in T_\alpha$  e  $a \in \omega - \text{ran } g$ . Sabemos que  $g$  é injetora, assim, basta mostrarmos que  $a \neq g(\beta)$  para todo  $\beta < \alpha$ , o que é verdade pela definição de  $a$
- (iii) Seja  $f \in T_{\alpha+1}$ , então temos  $f = g \cup \{\langle \alpha, a \rangle\}$  para alguma  $g \in T_\alpha$  e  $a \in \omega - \text{ran } g$ . Se  $\beta < \alpha + 1$ , então  $f|_\beta = g|_\beta \in T_\beta$  pois  $\beta \leq \alpha$
- (iv) Para qualquer  $\beta < \alpha + 1$ , qualquer  $g \in T_\beta$ , e qualquer  $X \subseteq \omega - \text{ran } g$  finito, existe uma  $f \in T_\alpha$  tal que  $g \subseteq f$  de  $\text{ran } f \cap X = \emptyset$ . Seja  $a \in \omega \setminus (\text{ran } f \cup X)$  (observe que é possível pois  $X$  é finito e  $\omega \setminus \text{ran } f$  é infinito). Então teremos que  $f \cup \{\langle \alpha, a \rangle\} \in T_{\alpha+1}$  é a função que desejamos

Agora, vamos contruir  $T_\lambda$  no caso em que  $\lambda$  é um ordinal limite. Considere um ordinal  $\beta < \lambda$ , um nó  $g \in T_\beta$  e um conjunto  $X \subseteq \omega - \text{ran } g$  finito. Vamos construir uma função  $f = f(g, X)$  da seguinte maneira: fixe uma sequência crescente  $\langle \lambda_n \rangle_{n=0}^\infty$  tal que  $\lambda_0 = \beta$  e  $\sup\{\lambda_n : n \in \mathbb{N}\} = \lambda$ . Seja  $f_0 = g \in T_{\lambda_0}$  e  $X_0 = X \subseteq \omega - \text{ran } f_0$ . Tendo definido  $f_n \in T_{\lambda_n}$  e  $X_n \subseteq \omega - \text{ran } f_n$  finito, nós primeiro tomamos um conjunto  $X_{n+1} \supsetneq X_n$  finito tal que  $X_{n+1} \subseteq \omega - \text{ran } f_n$  (Note que por (ii) este último passo é possível porque o conjunto  $\omega - \text{ran } f_n$  é infinito). Feito isso, escolhemos  $f_{n+1} \in T_{\lambda_{n+1}}$  tal que  $f_{n+1} \supseteq f_n$  e  $X_{n+1} \cap \text{ran } f_{n+1} = \emptyset$ , o que é possível por (iv).

Seja  $f = \bigcup_{n=0}^\infty f_n$ . Claramente  $f: \lambda \rightarrow \omega$  e  $f$  é injetora pois, como visto anteriormente, união de funções injetoras encadeadas também é função injetora. Além disso, temos que  $\text{ran } f \cap (\bigcup_{n=0}^\infty X_n) = \emptyset$  pois se  $X \in X_k$  e  $y \in X_k \cap \text{ran } f_n$ , então seja  $m = \max\{k, n\}$ , e temos que  $y \in X_m \cap \text{ran } f_m = \emptyset$  ( $f_n$  e  $X_n$  estão encadeados). Portanto  $\omega \setminus \text{ran } f$  é infinito e  $\text{ran } f \cap X = \emptyset$ . Assim concluímos que  $f$  satisfaz (ii). Ademais, se  $\beta < \lambda$ , tome  $n$  tal que  $\beta < \lambda_n$ , e teremos  $f|_\beta = (f_n)|_\beta \in T_\beta$  e portanto (iii) também é satisfeito (Perceba que  $f_n \in T_{\lambda_n}$  e  $\lambda_n < \lambda$ ).

Definimos  $T_\lambda \doteq \{f(g, X) : g \in \bigcup_{\beta < \lambda} T_\beta \text{ e cada } X \subseteq \omega \setminus \text{ran } g\}$ . Portanto (4) também é satisfeito por construção. Falta verificar (i). Com efeito,  $|T_\lambda| \leq |\bigcup_{\beta < \lambda} T_\beta| |\mathcal{P}^f(\omega)| \leq |\omega| \sum_{\beta < \lambda} |T_\beta| \leq \aleph_0^2 = \aleph_0$ , onde  $\mathcal{P}^f$  indica o conjunto das partes finitas.

Temos assim  $T$  árvore de Aronszajn de altura  $\omega_1$ . □

A questão da existência de árvores de Aronszajn é muito complicada e ainda não foi totalmente resolvida. De modo geral, dizemos que cardinais  $\kappa$  não-contáveis para os quais vale um análogo do Lema de König, i.e., não existem árvores de Aronszajn de altura  $\kappa$ ; dizemos que tais cardinais possuem a *propriedade de árvore*. O exercício a seguir nos mostra que cardinais singulares não satisfazem tal requisito.

**Exercício 3.4.** Construa uma árvore de Aronszajn de altura  $\aleph_\omega$ . Generalize para um cardinal singular  $\kappa$  qualquer.

*Solução.* Primeiramente daremos a ideia da demonstração: Fixado  $\kappa$ , queremos encontrar uma árvore de altura  $\kappa$ , cujos ramos têm comprimento estritamente menor que  $\kappa$  mas que  $\sup\{\ell(b), b \text{ ramo de } T\} = \kappa$ . Faremos isso da seguinte maneira: Como  $\kappa$  é singular, então existe  $\{\alpha_\eta : \eta < \lambda\}$  onde  $\lambda < \kappa$  com  $\sup\{\alpha_\eta\} = \kappa$ . Assim basta construir uma árvore formada por ramos “disjuntos” (cuja única intersecção é a raiz) com altura  $\alpha_\eta$  para todo  $\eta < \lambda$ . Agora construiremos tal árvore.

Seja  $\kappa$  ordinal singular, e  $\lambda = cf(\kappa) < \kappa$ . Então existe  $\{\alpha_\eta, \eta < \lambda\}$  subconjunto cofinal de  $\kappa$ . Vamos considerar o seguinte conjunto:

$$T \doteq \{f : \beta \rightarrow \kappa \mid \beta < \kappa \text{ e } \eta_f = f(0) < \lambda \text{ e } \text{dom}(f) < \alpha_{\eta_f} \text{ e } f(\eta) = 0 \text{ para } \eta \neq 0\} \cup \{\emptyset\}$$

Observe que  $T$  é ordenado pela ordem usual de funções e que para  $\emptyset \neq f, g \in T, f \leq g \iff f(0) = g(0), \text{dom } f \subseteq \text{dom } g$ . Vamos provar que  $T$  é uma árvore:  $\{\emptyset\}$  é o menor elemento de  $T$ . Seja  $A_x = \{y \in T : y < x\}$  e observe que  $A_x$  possui o mesmo tipo de ordem de  $\text{dom } x$ , que é bem ordenado. Assim  $T$  é uma árvore.

Seus ramos são da forma  $b_\eta = \{f \in T : f(0) = \eta\}$  para algum  $\eta < \lambda$ : Se  $b_\eta = \{f \in T : f(0) = \eta\}$  para algum  $\eta < \lambda$ , sejam  $f, g \in b_\eta$ , então  $f(0) = g(0)$  e sem perda de generalidade temos  $\text{dom } f \subseteq \text{dom } g$ , logo  $f \leq g$ .  $b_\eta$  é maximal pois suponhamos  $b_\eta \subsetneq c$  com  $c$  cadeia, então existe  $f \in c$  com  $f(0) \neq \eta$ , logo  $f$  não é

comparável com qualquer elemento de  $b_\eta$ . Agora se  $b$  é ramo qualquer de  $T$ , vamos provar que  $b \subset b_\xi$  para algum  $\xi < \eta$ : De fato tome  $f \in b$  e  $\xi \dot{=} \eta_f = f(0)$ , então se  $g \in b$ , ou  $g \leq f$  ou  $g \geq f$  pois  $b$  é uma cadeia. De toda forma,  $g(0) = f(0) = \xi \implies g \in b_\xi$ . Como  $b$  é maximal e  $b \subset b_\xi$  então  $b = b_\xi$  pois  $b_\xi$  é ramo (maximal).

Observe que construímos  $T$  para que  $b_\eta = \{f \in T : f(0) = \eta\}$  tenha tipo de ordem  $\ell(b_\eta) = \alpha_\eta < \kappa$ . Além disso  $h(T) = \sup\{\alpha_\eta : \eta < \lambda\} = \kappa$  e portanto  $T$  é árvore de Aronszajn de cardinalidade  $\kappa$  cardinal singular.

□

Assim encerra-se a Seção 3 sobre árvores.

## Referências

- [1] Karel Hrbacek and Thomas Jech. *Introduction to Set Theory*. Marcel Dekker, 1999.