

# 1. 映射和函数

## 1.1 映射

- 映射

设 $X$ 、 $Y$ 是两个非空集合，如果存在一个法则 $f$ ，使得对 $X$ 中每个元素 $x$ ，按照法则 $f$ ，在 $Y$ 中有唯一确定的元素 $y$ 与之对应，则称 $f$ 为从 $X$ 到 $Y$ 的一个映射，记作：

$$f: X \rightarrow Y$$

- 其中：

- 元素 $y$ 称为元素 $x$ 在映射 $f$ 下的像，记作 $f(x)$ ，也即 $y = f(x)$
- 元素 $x$ 称为元素 $y$ 在映射 $f$ 下的原像
- 集合 $X$ ，集合 $Y$ ，和映射法则 $f$ 是构成映射的三大要素

- 定义域：

- 集合 $X$ 称为映射 $f$ 的定义域，记作 $D_f$ ，也即 $D_f = X$

- 值域：

- $X$ 中所有元素的像组成的集合称为映射 $f$ 的值域，记作 $R_f$ 或 $f(X)$
- 也即， $R_f = f(X) = \{f(x) | x \in X\}$
- 注意， $R_f \subset Y$ ，不一定 $R_f = Y$

- 

- 映射的类型

- 满射

设 $f$ 是从集合 $X$ 到集合 $Y$ 的一个映射，如果 $R_f = Y$ ，也即， $Y$ 中任一个元素 $y$ 都是 $X$ 中某个元素的像，则称 $f$ 是从 $X$ 到 $Y$ 上的映射，也称为满射

- 单射

设 $f$ 是从集合 $X$ 到集合 $Y$ 的一个映射，若对集合 $X$ 中任意两个不同元素 $x_1 \neq x_2$ ，他们的像 $f(x_1) \neq f(x_2)$ ，则称 $f$ 为 $X$ 到 $Y$ 的单射

- 双射

若一个映射 $f$ 即是单射，又是满射，则称为一一映射或双射

- 逆映射

设 $f$ 是 $X$ 到 $Y$ 的单射，则有定义可知，对于每个 $y \in R_f$ ，有唯一的 $x \in X$ ，适合 $f(x) = y$ ，于是，可以定义一个新的映射 $g$ ，即

$$g: R_f \rightarrow X$$

对每个 $y \in R_f$ ，规定 $g(y) = x$ ， $x$ 满足 $f(x) = y$ ，则新映射 $g$ 称为 $f$ 的逆映射，记作 $f^{-1}$

定义域 $D_{f^{-1}} = R_f$ ，值域 $R_{f^{-1}} = X$

- 只有单射才有逆映射，否则从 $g(y) = x$ 可能出现多个 $x$ 值，导致不符合映射定义

- 复合映射

设有两个映射,

$g: X \rightarrow Y_1, f: Y_2 \rightarrow Z$ , 其中  $Y_1 \subset Y_2$

则由映射  $g$  和  $f$  确定了一个从  $X \rightarrow Z$  的映射, 该映射称为复合映射, 表示将每个  $x \in X$ , 映射为  $f(g(x)) \in Z$

复合映射记为  $f \circ g$ , 也即  $f \circ g: X \rightarrow Z, (f \circ g)(x) = f(g(x)), x \in X$

- 构成复合映射的条件:  $\circ$  符号右侧映射的值域, 在符号左侧映射的定义域内
- 复合映射的书写顺序与映射实际顺序相反, 即, 如果是  $f \circ g \circ h$ , 则先是映射  $h(x)$ , 再是  $g(h(x))$ , 最后是  $f(g(h(x)))$

## 1.2 函数

### 1. 函数的定义

设数集  $D \subset R$ , 则称映射  $f: D \rightarrow R$  为定义在数集  $D$  上的函数, 记为  $y = f(x), x \in D$

- $x$  称为自变量,  $y$  称为因变量,  $D$  称为定义域, 记为  $D_f$ , 也即  $D = D_f$
- 构成函数的要素: 定义域  $D_f$  和对应法则  $f$ 
  - 因为函数本身是从实数集映射到实数集的映射

函数的定义中, 每个  $x \in D$ , 按照对应法则  $f$ , 总有唯一确定的值  $y$  与  $x$  对应, 这个值称为函数  $f$  在  $x$  处的函数值, 记为  $f(x)$ , 也即  $y = f(x)$

函数值  $f(x)$  的全体所构成的集合称为函数  $f$  的值域, 记作  $R_f$  或  $f(D)$

符号  $f$  与  $f(x)$

- 通常来说,  $f$  表示自变量和因变量之间的对应法则,  $f(x)$  表示与自变量  $x$  对应的函数值
- 但通常为了叙述方便, 常用  $y = f(x) \ x \in D$  来表示定义在数集  $D$  上的函数, 此时  $f(x)$  表示由它确定的函数  $f$

### 2. 函数的性质

- 有界性

设函数  $f(x)$  的定义域为  $D$ , 数集  $X \subset D$

如果存在数  $K_1$ , 使得  $f(x) \leq K_1$  对任意的  $x \in X$  都成立, 则称函数  $f(x)$  在  $X$  上有上界,  $K_1$  是函数  $f(x)$  在  $X$  上的一个上界

如果存在数  $K_2$ , 使得  $f(x) \geq K_2$  对任意的  $x \in X$  都成立, 则称函数  $f(x)$  在  $X$  上有下界,  $K_2$  是函数  $f(x)$  在  $X$  上的一个下界

如果存在正数  $M$ , 使得  $|f(x)| \leq M$  对任意的  $x \in X$  都成立, 则称函数  $f(x)$  在  $X$  上有界

如果对于任意正数  $M$ , 总存在  $x_1 \in X$  使得  $|f(x)| > M$ , 则称函数  $f(x)$  在  $X$  上无界

如果对于整个定义域, 上述成立, 则成为全局有界/无界

函数  $f(x)$  在  $X$  上有界  $\Leftrightarrow f(x)$  在  $X$  上既有上界又有下界

- 单调性

设函数  $f(x)$  的定义域为  $D$ , 区间  $I \subset D$ , 如果对于区间  $I$  上任意两点  $x_1, x_2$

当  $x_1 < x_2$  时, 恒有  $f(x_1) < f(x_2)$ , 那么称函数  $f(x)$  在区间  $I$  上是单调递增的

当  $x_1 < x_2$  时, 恒有  $f(x_1) > f(x_2)$ , 那么称函数  $f(x)$  在区间  $I$  上是单调递减的

单调, 特指不包含等于

单调递增函数和单调递减函数统称为单调函数

#### ◦ 奇偶性

设函数 $f(x)$ 的定义域为 $D$ 关于原点对称

如果对于任意 $x \in D$ , 有 $f(-x) = f(x)$ 恒成立, 则称 $f(x)$ 为偶函数, 关于 $y$ 轴对称

如果对于任意 $x \in D$ , 有 $-f(x) = f(-x)$ 恒成立, 则称 $f(x)$ 为奇函数, 关于原点对称

奇偶性不具有可加性

#### ◦ 周期性

设函数 $f(x)$ 的定义域为 $D$ , 如果存在一个正数 $l$ , 使得对于任意 $x \in D$ , 有 $x \pm l \in D$ , 且 $f(x+l) = f(x)$ 恒成立

则称函数 $f(x)$ 为周期函数,  $l$ 称为函数 $f(x)$ 的周期

通常周期函数的周期, 指的是最小正周期

■ 并非每个函数都有最小正周期

■ 狄利克雷函数, 
$$D(x) = \begin{cases} 1, & x \in Q \\ 0, & x \in Q^C \end{cases}$$

■ 任何正有理数 $r$ 都是周期, 故而不存在最小正周期

### 3. 反函数和复合函数

#### ◦ 反函数

设函数 $f: D \rightarrow f(D)$ 是单射, 则存在逆映射 $f^{-1}: f(D) \rightarrow D$ , 称 $f^{-1}$ 为函数 $f$ 的反函数

对于每个 $y \in f(D)$ , 有唯一的 $x \in D$ , 有 $f^{-1}(y) = x$

反函数和其直接函数, 关于 $y = x$ 对称

**若直接函数是单调函数, 则其反函数也是单调函数, 且单调性相同**

#### ◦ 复合函数

设函数 $y = f(x)$ 的定义域为 $D_f$ , 函数 $u = g(x)$ 的定义域为 $D_g$ , 且其值域 $R_g \subset D_f$ , 则下式确定的函数

$$y = f[g(x)], \quad x \in D_g$$

称为由函数 $u = g(x)$ 和函数 $y = f(x)$ 构成的复合函数, 定义域为 $D_g$

构成复合函数的条件是,  $\circ$ 右侧的函数的值域, 在 $\circ$ 左侧的函数的定义域内

$$f \circ g \text{ 要求 } R_g \subset D_f$$

$f \circ g$ 表示由函数 $g(x)$ 和函数 $f(x)$ 复合而来, 按照先 $g$ 后 $f$ 的次序复合

### 4. 初等函数

#### ◦ 基本初等函数

- 幂函数,  $y = x^\mu, \mu \in R$ 是常数
- 指数函数,  $y = a^x, a > 0$ 且 $a \neq 1$
- 对数函数,  $y = \log_a(x), a > 0$ 且 $a \neq 1$
- 三角函数,  $\text{trig}(x)$

- 反三角函数,  $\arctrig(x)$ 或 $\text{trig}^{-1}(x)$
- 初等函数

通过基本初等函数, 和常数, 经过有限次的四则运算, 和有限次的函数复合所构成, 并可用一个式子表示的函数, 称为初等函数

## 2. 数列的极限

### 2.1 数列极限的定义

数列

如果按照**某一法则**, 对每个 $n \in N_+$ , 对应一个确定的实数 $x_n$ , 将这些实数按照下标从小到大的顺序排列得到的序列, 称为数列, 记为 $\{x_n\}$

$x_n$ 称为一般项或通项, 通常用公式表示

数列的极限

设 $\{x_n\}$ 是一个数列, 如果存在常数 $a$ , 对于任意给定的正数 $\varepsilon$ (不论多么小), 总存在正整数 $N$ , 使得 $n > N$ 时, 不等式

$$|x_n - a| < \varepsilon$$

都成立, 那么就称**常数 $a$ 是数列 $\{x_n\}$ 的极限**, 记为 $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = a$ , 或称 $\{x_n\}$ **收敛于 $a$** , 记为 $x_n \rightarrow a (n \rightarrow \infty)$

- 如果不存在这样的常数 $a$ , 则说明数列 $\{x_n\}$ 是发散的, 或 $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n$ 不存在 **$DNE$**
- 正数 $\varepsilon$ 可以任意给定是重要前提, 这样 $|x_n - a| < \varepsilon$ 才可以表达出 $x_n$ 与 $a$ **无限接近**的意思
- 正整数 $N$ 是和 $\varepsilon$ 相关的, 随着 $\varepsilon$ 的给定而确定
- $|x_n - a| < \varepsilon$ 表示的内容
  - 极限表示的是 $\{x_n\}$ 无限接近值 $a$ , 也即两者相差**几乎为0**, 所以 $|x_n - a|$ 任意小, 因此可以使用 $\forall \varepsilon > 0, |x_n - a| < \varepsilon$

数列极限符号表达

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = a \Leftrightarrow \forall \varepsilon > 0, \exists \text{正整数 } N, \text{ 当 } n > N \text{ 时, 有 } |x_n - a| < \varepsilon$$

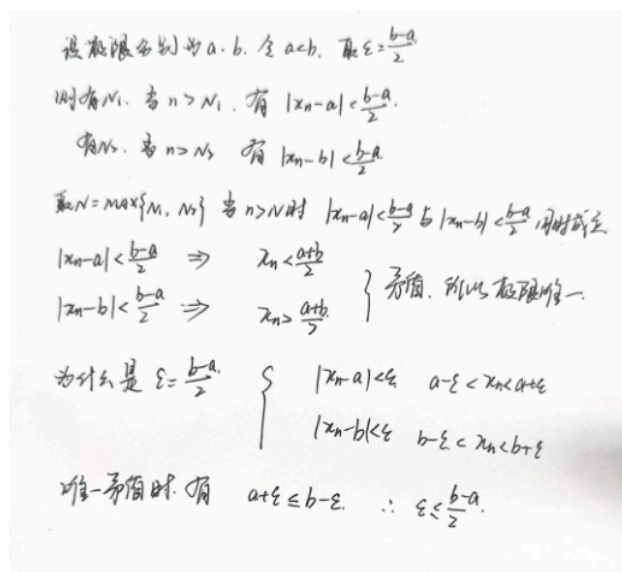
数列极限的几何意义

当 $n > N$ 时, 所有的 $x_n$ 的点都落在数轴上的开区间 $(a - \varepsilon, a + \varepsilon)$ 内

### 2.2 收敛数列的性质

#### 1. 极限的唯一性

如果数列 $\{x_n\}$ 收敛, 那么极限唯一



## 2. 收敛数列的有界性

如果数列  $\{x_n\}$  收敛, 那么数列  $\{x_n\}$  一定有界

### ◦ 数列有界的定义

对于数列  $\{x_n\}$ , 如果存在一个正整数  $M$ , 使得对于一切  $\{x_n\}$  都满足不等式

$$|x_n| \leq M$$

则称数列  $\{x_n\}$  有界, 如果这样的正整数  $M$  不存在, 则称数列  $\{x_n\}$  无界

## 3. 收敛数列的保号性

如果数列  $\{x_n\}$  收敛于  $a$ , 或  $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = a$ , 且  $a > 0$  (或  $a < 0$ ), 则存在正整数  $N$ , 当  $n > N$  时, 都有  $x_n > 0$  (或  $x_n < 0$ )

### 保号性推论

如果数列  $\{x_n\}$  从某项起有  $x_n \geq 0$  (或  $x_n \leq 0$ ), 且数列  $\{x_n\}$  收敛于  $a$ , 那么有  $a \geq 0$  (或  $a \leq 0$ )

## 4. 收敛数列与其子数列间的关系

如果数列  $\{x_n\}$  收敛于  $a$ , 那么他的任一子数列也收敛, 且也收敛于  $a$

- 如果一个数列  $\{x_n\}$  的两个子数列收敛于不同值, 则可知原数列  $\{x_n\}$  是发散的
- 如果数列  $\{x_n\}$  是发散的, 但其子数列可能是收敛的

### ◦ 子数列定义

从数列  $\{x_n\}$  中任意抽取无限多项, 且保持这些项在原数列  $\{x_n\}$  中的先后次序, 这样得到的新数列, 就称为原数列  $\{x_n\}$  的子数列

# 3. 函数的极限

## 3.1 函数极限的定义

- 自变量  $x$  趋于有限值  $x_0$

设函数 $f(x)$ 在点 $x_0$ 的某一去心邻域内有定义, 如果存在常数 $A$ , 对任意给定的正数 $\varepsilon$ (不论他多么小), 总存在正数 $\delta$ , 使得当 $x$ 满足 $0 < |x - x_0| < \delta$ 时, 对应的函数值 $f(x)$ 都满足不等式

$$|f(x) - A| < \varepsilon$$

则常数 $A$ 叫做函数 $f(x)$ , 当 $x \rightarrow x_0$ 时的极限, 记作 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$ , 或

$f(x) \rightarrow A$ , 当 $x \rightarrow x_0$ 时

○ 定义中指明 $0 < |x - x_0| < \delta$ , 说明

■  $x \neq x_0$ , 这说明函数在 $x_0$ 处有没有极限, 和 $f(x)$ 在 $x_0$ 处有无定义没有关系

■  $\delta$ 表示的是 $x_0$ 邻域半径, 表示了 $x$ 和 $x_0$ 的接近程度

○  $|f(x) - A| < \varepsilon$ 表示的内容

■ 极限表示的是 $f(x)$ 无限接近值 $A$ , 也即两者相差几乎为0, 所以 $|f(x) - A|$ 任意小, 因此可以使用 $\forall \varepsilon > 0, |f(x) - A| < \varepsilon$

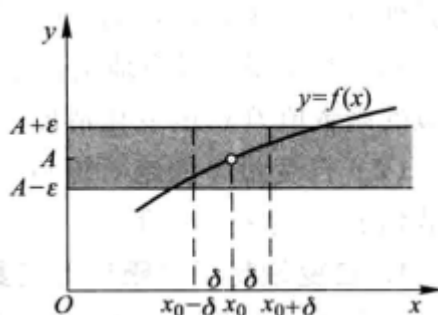
○  $\delta$ 是由 $\varepsilon$ 控制的, 给定了 $\varepsilon$ , 就可以找到一个对应的正数 $\delta$ , 也因此, 不需要要求 $\delta$ 像 $\varepsilon$ 那样, 有无论多小的限制

○  $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$ 的几何意义

■ 对于给定的常数 $A$ 和任意正数 $\varepsilon$ , 在 $y$ 轴做两条平行于 $x$ 轴的水平线, 在水平线之间的区域, 就是我们希望接近于 $A$ 的范围

■ 根据给定的范围, 在点 $x_0$ 附近可以找到一个 $\delta$ 邻域,  $(x - \delta, x + \delta)$ , 此处说明 $\delta$ 是由 $\varepsilon$ 控制的

■ 因此当函数 $f(x)$ 上的点, 其横坐标落到 $(x - \delta, x + \delta)$ 且 $x \neq x_0$ 时, 这些点的纵坐标就会落在水平线区域内, 也即满足不等式 $|f(x) - A| < \varepsilon$



• 单侧极限

○ 左右极限统称为单侧极限

○ 左极限

■ 设函数 $f(x)$ 在点 $x_0$ 的某一去心邻域内有定义, 如果存在常数 $A$ , 对任意给定的正数 $\varepsilon$ (不论他多么小), 总存在正数 $\delta$ , 使得当 $x$ 满足 $-\delta < x - x_0 < 0$ 时, 对应的函数值 $f(x)$ 都满足不等式

$$|f(x) - A| < \varepsilon$$

则常数 $A$ 叫做函数 $f(x)$ , 当 $x \rightarrow x_0^-$ 时的极限, 记作 $\lim_{x \rightarrow x_0^-} f(x) = A$ , 或

$f(x) \rightarrow A$ , 当 $x \rightarrow x_0^-$ 时

○ 右极限

- 设函数  $f(x)$  在点  $x_0$  的某一去心邻域内有定义, 如果存在常数  $A$ , 对任意给定的正数  $\varepsilon$  (不论他多么小), 总存在正数  $\delta$ , 使得当  $x$  满足  $0 < x - x_0 < \delta$  时, 对应的函数值  $f(x)$  都满足不等式

$$|f(x) - A| < \varepsilon$$

则常数  $A$  叫做函数  $f(x)$ , 当  $x \rightarrow x_0^+$  时的极限, 记作  $\lim_{x \rightarrow x_0^+} f(x) = A$ , 或

$$f(x) \rightarrow A, \text{ 当 } x \rightarrow x_0^+ \text{ 时}$$

- 函数  $f(x)$ , 在  $x \rightarrow x_0$  时极限存在的充要条件是: **左右极限存在且相等**

- 自变量  $x$  的绝对值  $|x|$  趋于无穷大

- 设函数  $f(x)$  当  $|x|$  大于某一正数时有定义, 如果存在常数  $A$ , 对任意给定的正数  $\varepsilon$  (不论他多么小), 总存在正数  $X$ , 使得当  $|x| > X$  时, 对应的函数值  $f(x)$  都满足不等式

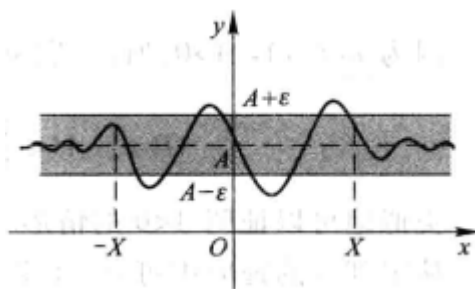
$$|f(x) - A| < \varepsilon$$

那么常数  $A$  叫做函数  $f(x)$ , 当  $x \rightarrow \infty$  时的极限, 记作  $\lim_{x \rightarrow \infty} f(x) = A$ , 或

$$f(x) \rightarrow A, \text{ 当 } x \rightarrow \infty \text{ 时}$$

- $\lim_{x \rightarrow \infty} f(x) = A$  的几何意义

- 对于给定的常数  $A$  和任意正数  $\varepsilon$ , 在  $y$  轴做两条平行于  $x$  轴的水平线, 在水平线之间的区域, 就是我们希望接近于  $A$  的范围
- 根据  $\varepsilon$  可以找到一个正数  $X$ , 使得对于所有  $|x| > X$ , 函数  $f(x)$  的值都会落在水平线之间的区域



## 3.2 函数极限的性质

仅给出  $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$  的形式, 但对  $\lim_{x \rightarrow \infty} f(x) = A$  也成立

### 1. 函数极限唯一性

如果函数极限  $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$  存在, 那么极限唯一

### 2. 函数极限局部有界性

如果函数极限  $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$  存在, 那么存在正常数  $M$  和  $\delta$ , 使得当  $0 < |x - x_0| < \delta$  时,  $|f(x)| \leq M$

### 3. 函数极限局部保号性

如果函数极限  $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$ , 且  $A > 0$  (或  $A < 0$ ), 那么存在正常数  $\delta$ , 使得当  $0 < |x - x_0| < \delta$  时,  $f(x) > 0$ , 或  $f(x) < 0$

如果函数极限  $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$ , 且  $A \neq 0$ , 那么就存在  $x_0$  的某一去心邻域  $\dot{U}(x_0)$

当 $x \in \overset{\circ}{U}(x_0)$ 时, 有 $|f(x)| > \frac{|A|}{2}$

如果在 $x_0$ 的某个去心邻域内 $f(x) \geq 0$ , 或有 $f(x) \leq 0$ , 且当 $x \rightarrow x_0$ 时, 且 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$ , 那么 $A \geq 0$ , 或 $A \leq 0$

#### 4. 函数极限与数列极限的关系

如果函数极限 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$ 存在,  $\{x_n\}$ 为函数 $f(x)$ 的定义域内, 任意收敛于 $x_0$ 的数列, 且满足 $x_n \neq x_0$

那么相应的函数值数列 $\{f(x_n)\}$ 必收敛, 且 $\lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = \lim_{x \rightarrow x_0} f(x)$

## 4. 无穷大和无穷小

无穷大/无穷小, 指的均是函数, 而不是具体的值

### • 无穷小

如果函数 $f(x)$ 当 $x \rightarrow x_0$ , 或 $x \rightarrow \infty$ 时的极限为0, 那么称函数 $f(x)$ 为当 $x \rightarrow x_0$ , 或 $x \rightarrow \infty$ 时的无穷小

#### ◦ 无穷小QA

■ Q: 为什么0是无穷小而不是负数?

■ A: 根据无穷小的定义可知, 是当自变量 $x \rightarrow x_0$ 或 $x \rightarrow \infty$ 时, 函数的极限为0, 根据极限的定义, 极限为0是指 $|f(x) - 0| < \varepsilon$ , 也即 $|f(x)| < \varepsilon$ , 含有绝对值, 因此以0为无穷小的标准

■ Q: 无穷小是值还是函数?

■ A: 无穷小是函数, 具体的值, 无法体现对任意的 $\varepsilon$ , 都有 $|f(x)| < \varepsilon$

#### ◦ 无穷小与极限存在

在自变量的同一变化过程 $x \rightarrow x_0$ , 或 $x \rightarrow \infty$ 中, 函数 $f(x)$ 具有极限 $A$ 的充要条件是,  $f(x) = A + \alpha$ ,  $\alpha$ 是无穷小

### • 无穷大

设函数 $f(x)$ 在 $x_0$ 的某一去心邻域内有定义(或 $|x|$ 大于某一正数时有定义), 如果对于任意给定的正数 $M$ (无论 $M$ 多么大), 总存在正数 $\delta$ , (或正数 $X$ ), 只要 $x$ 适合不等式 $0 < |x - x_0| < \delta$  (或 $|x| > X$ ), 对应的函数值总满足不等式

$$|f(x)| > M$$

那么称函数 $f(x)$ 为当 $x \rightarrow x_0$ , 或 $x \rightarrow \infty$ 时的无穷大

按照极限定义, 无穷大的函数, 极限是不存在的, 但为了叙述方便, 也可以称函数的极限是无穷大,  $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = \infty$ , 或,  $\lim_{x \rightarrow \infty} f(x) = \infty$

#### ◦ 无穷大与无穷小

在自变量的同一变化过程中, 如果 $f(x)$ 为无穷大, 那么 $\frac{1}{f(x)}$ 为无穷小; 如果 $f(x)$ 为无穷小, 且 $f(x) \neq 0$ , 则 $\frac{1}{f(x)}$ 为无穷大

## 5. 极限运算法则

- 使用极限运算法则, 可以求解部分函数的极限



- 针对  $x \rightarrow x_0$  和  $x \rightarrow \infty$  都成立

- 定理1

- 两个无穷小的和仍是无穷小

- 推论

- 有限个无穷小的和仍是无穷小

- 定理2

- 有界函数与无穷小的乘积是无穷小

- 推论1

- 常数与无穷小的乘积是无穷小

- 推论2

- 有限个无穷小的乘积是无穷小

- 定理3

- 如果  $\lim f(x) = A$ ,  $\lim g(x) = B$ , 则有

- $\lim [f(x) \pm g(x)] = \lim f(x) \pm \lim g(x) = A \pm B$
- $\lim [f(x) \times g(x)] = \lim f(x) \times \lim g(x) = A \times B$
- 若  $B \neq 0$ ,  $\lim \frac{f(x)}{g(x)} = \frac{\lim f(x)}{\lim g(x)} = \frac{A}{B}$

- 推论1

- 如果  $f(x)$  的极限存在, 而  $c$  为常数, 那么  $\lim [cf(x)] = c \lim f(x)$

- 推论2

- 如果  $f(x)$  的极限存在, 而  $n$  是正整数, 那么  $\lim [f(x)]^n = [\lim f(x)]^n$

- 定理4

- 设有数列  $\{x_n\}$ ,  $\{y_n\}$ , 如果  $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = A$ ,  $\lim_{n \rightarrow \infty} y_n = B$ , 则有

- $\lim_{n \rightarrow \infty} (x_n + y_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} x_n + \lim_{n \rightarrow \infty} y_n = A + B$
- $\lim_{n \rightarrow \infty} (x_n \times y_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} x_n \times \lim_{n \rightarrow \infty} y_n = A \times B$
- 若  $B \neq 0$ ,  $\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{x_n}{y_n} = \frac{\lim_{n \rightarrow \infty} x_n}{\lim_{n \rightarrow \infty} y_n} = \frac{A}{B}$

- 定理5

- 如果  $\varphi(x) \geq \psi(x)$ , 且  $\lim \varphi(x) = A$ ,  $\lim \psi(x) = B$ , 那么  $A \geq B$

- 定理6

- 设函数  $y = f[g(x)]$  是由函数  $u = g(x)$  和  $y = f(u)$  复合而来, 且  $f[g(x)]$  在  $x_0$  的某一去心邻域内有定义

$$\text{若 } \lim_{x \rightarrow x_0} u(x) = u_0, \lim_{u \rightarrow u_0} f(u) = A$$

且存在  $\delta_0 > 0$ , 当  $x \in \overset{\circ}{U}(x_0, \delta_0)$  时, 有  $g(x) \neq u_0$ , 那么

$$\lim_{x \rightarrow x_0} f[g(x)] = \lim_{u \rightarrow u_0} f(u) = A$$

- 极限求解方法之一

涉及多项式, 和有理分式的极限

- 当  $x \rightarrow x_0$  时
  - 如果是多项式函数的极限，可以将  $x_0$  带入函数直接计算出极限
  - 如果是有理分式的极限，且分母带入  $x_0$  后不为 0，可以将  $x_0$  带入函数直接计算出极限
    - 如果分母为 0
      - 先考虑约分是否可以计算出极限
      - 再考虑如果分母为 0，分子不为 0，则其倒数的极限为 0，也即无穷小，根据无穷小的性质，可推断原有理分式极限为  $\infty$
      - 都不可以考虑其他方法
- 当  $x \rightarrow \infty$  时
  - 如果是有理分式的极限，根据分子分母中，系数非零的最高次项的次数，进行判断
    - 分子次数 < 分母次数，极限为 0
    - 分子次数 = 分母次数，极限为分子分母中最高次项的系数之比
    - 分子次数 > 分母次数，极限为  $\infty$

## 6. 极限存在准则 与 两个重要极限

### 1. 准则一 夹逼定理

如果数列  $\{x_n\}$ ,  $\{y_n\}$ ,  $\{z_n\}$  满足以下条件

- 从某项起，即  $\exists n_0 \in \mathbb{N}^+$ ，当  $n > n_0$  时，有  $\{y_n\} \leq \{x_n\} \leq \{z_n\}$
- $\lim_{n \rightarrow \infty} y_n = a$ ,  $\lim_{n \rightarrow \infty} z_n = a$

那么数列  $\{x_n\}$  的极限存在，且也为  $a$

如果函数  $f(x)$ ,  $g(x)$ ,  $h(x)$  满足以下条件

- 对  $x \in \overset{\circ}{U}(x_0, r)$  (或  $|x| > X$ )，有  $g(x) \leq f(x) \leq h(x)$
- $\lim_{n \rightarrow \infty} g(x) = A$ ,  $\lim_{n \rightarrow \infty} h(x) = A$  或  $\lim_{n \rightarrow x_0} g(x) = A$ ,  $\lim_{n \rightarrow x_0} h(x) = A$

那么函数  $f(x)$  的极限存在，且也为  $A$

### 2. 准则二 单调有界数列必有极限

#### 充分条件

如果数列  $\{x_n\}$  单调且有界，那么数列  $\{x_n\}$  一定有极限，也即一定收敛

此处的单调是广义的，包含等号

设函数  $f(x)$  在点  $x_0$  的某个左邻域内单调且有界，则  $f(x)$  在  $x_0$  的左极限必定存在

设函数  $f(x)$  在点  $x_0$  的某个右邻域内单调且有界，则  $f(x)$  在  $x_0$  的右极限必定存在

设  $X$  是任意大的正数，函数  $f(x)$  在  $x > X$  的区间上单调且有界，则  $f(x)$  在  $x \rightarrow +\infty$  的极限必定存在

设  $X$  是任意大的正数，函数  $f(x)$  在  $x < -X$  的区间上单调且有界，则  $f(x)$  在  $x \rightarrow -\infty$  的极限必定存在

### 3. 柯西极限存在准则(柯西审敛原理)

数列 $\{x_n\}$ 收敛的充分必要条件是：

对于任意给定的正数 $\varepsilon$ ，存在正整数 $N$ ，使得当 $n > N$ ， $n > N$ 时，有

$$|x_n - x_m| < \varepsilon$$

可以推广到函数极限存在的充要条件

- 两个重要极限

- $\lim_{x \rightarrow 0} \frac{\sin(x)}{x} = 1$

- $\lim_{x \rightarrow \infty} (1 + \frac{1}{x})^x = e$

- 更一般的形式

- $\lim_{n \rightarrow \infty} (1 + \frac{x}{n})^n = e^x$

- $\lim_{h \rightarrow 0} (1 + hx)^{\frac{1}{h}} = e^x$

## 7. 无穷小比较

- 两个无穷小的和/差/积都是无穷小，但对于商，会存在等于0， $\infty$ ， $c \neq 0$ 的情形

- 比值为0，说明分子趋于零的速度快于分母趋于零的速度
  - 比值为 $\infty$ ，说明分母趋于零的速度快于分子趋于零的速度
  - 比值为1，说明分子分母趋于零的速度快慢相仿

- 无穷小比值相关定理

- $\alpha, \beta$ 都是同一个自变量变化过程中的无穷小，且 $\alpha \neq 0$ ， $\lim \frac{\beta}{\alpha}$ 也是同一自变量变化过程中的极限

如果 $\lim \frac{\beta}{\alpha} = 0$ ，那么就说 $\beta$ 是比 $\alpha$ 高阶的无穷小，记作 $\beta = o(\alpha)$

如果 $\lim \frac{\beta}{\alpha} = \infty$ ，那么就说 $\beta$ 是比 $\alpha$ 低阶的无穷小

如果 $\lim \frac{\beta}{\alpha} = c \neq 0$ ，那么就说 $\beta$ 与 $\alpha$ 同阶的无穷小

如果 $\lim \frac{\beta}{\alpha^k} = c \neq 0, k > 0$ ，那么就说 $\beta$ 是关于 $\alpha$ 的 $k$ 阶无穷小

如果 $\lim \frac{\beta}{\alpha} = 1$ ，那么就说 $\beta$ 与 $\alpha$ 是等价无穷小，记作 $\beta \sim \alpha$

等价无穷小具有如下性质

- 自反性， $\alpha \sim \alpha$
  - 对称性，若 $\alpha \sim \beta$ ，则 $\beta \sim \alpha$
  - 传递性，若 $\alpha \sim \beta, \beta \sim \gamma$ ，则 $\alpha \sim \gamma$

- 定理一：

$\beta$ 和 $\alpha$ 是等价无穷小的充要条件是， $\beta = \alpha + o(\alpha)$

- 定理二：

设 $\alpha \sim \tilde{\alpha}, \beta \sim \tilde{\beta}$ ，且极限 $\lim \frac{\tilde{\beta}}{\tilde{\alpha}}$ 存在，则

$$\lim \frac{\beta}{\alpha} = \lim \frac{\tilde{\beta}}{\tilde{\alpha}}$$

- 常见等价无穷小

当  $x \rightarrow 0$  时有如下等价无穷小

- $\sin(x) \sim x$
- $\tan(x) \sim x$
- $\arcsin(x) \sim x$
- $\arctan(x) \sim x$
- $1 - \cos(x) \sim \frac{1}{2}x^2$
- $\sec(x) - 1 \sim \frac{1}{2}x^2$
- $e^x - 1 \sim x$
- $\sqrt[n]{1+x} - 1 \sim \frac{1}{n}x$

■ 证明过程

证明当  $x \rightarrow 0$  时,  $\sqrt[n]{1+x} - 1 \sim \frac{1}{n}x$

$$\lim_{x \rightarrow 0} \frac{\sqrt[n]{1+x} - 1}{\frac{1}{n}x}$$

根据二项式公式  $a^n - b^n = (a-b)(a^{n-1} + a^{n-2}b + a^{n-3}b^2 + \dots + b^{n-1})$

约分后极限为

$$\lim_{x \rightarrow 0} \frac{\sqrt[n]{1+x} - 1}{\frac{1}{n}x}$$
$$= \lim_{x \rightarrow 0} \frac{(\sqrt[n]{1+x} - 1)(\sqrt[n]{1+x}^{n-1} + \sqrt[n]{1+x}^{n-2} + \dots + 1)}{\frac{1}{n}x \cdot (\sqrt[n]{1+x}^{n-1} + \sqrt[n]{1+x}^{n-2} + \dots + 1)}$$
$$= \lim_{x \rightarrow 0} \frac{x}{\frac{1}{n}x (\sqrt[n]{1+x}^{n-1} + \sqrt[n]{1+x}^{n-2} + \dots + 1)}$$
$$= \lim_{x \rightarrow 0} \frac{n}{\sqrt[n]{1+x}^{n-1} + \sqrt[n]{1+x}^{n-2} + \dots + 1}$$
$$= \frac{n}{\underbrace{1+1+\dots+1}_{n \text{ 个}}} = 1$$

$\therefore \sqrt[n]{1+x} - 1 \sim \frac{1}{n}x$

## 8. 函数的连续性和间断点

- 增量变量的描述
  - 变量从一个初值变到终值, 终值与初值的差就叫做变量的增量, 记作  $\Delta x$ , 变量可任取
  - 设函数  $f(x)$  在  $x_0$  的某邻域内是有定义的, 则, 函数的增量, 指的是自变量  $x$  在该邻域内, 从  $x_0$  变到  $x_0 + \Delta x$  时, 函数值  $f(x)$  相应的从  $f(x_0)$  变到  $f(x_0 + \Delta x)$ , 将此变化记为  $\Delta y = f(x_0 + \Delta x) - f(x_0)$
- 在某点  $x_0$  处连续
  - 增量表示法

设函数 $f(x)$ 在点 $x_0$ 的某一领域内有定义, 如果 $\lim_{\Delta x \rightarrow 0} f(x_0 + \Delta x) - f(x_0) = 0$ , 则

称函数 $y = f(x)$ 在点 $x_0$ 连续

#### ○ 函数表示法

设函数 $f(x)$ 在点 $x_0$ 的某一领域内有定义, 如果 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = f(x_0)$ , 则称函数

$y = f(x)$ 在点 $x_0$ 连续

#### ■ 变化过程:

■ 令 $x = x_0 + \Delta x$ , 所以当 $\Delta x \rightarrow 0$ , 意味着 $x \rightarrow x_0$

■  $\Delta y = f(x) - f(x_0)$ , 所以有 $f(x) = f(x_0) + \Delta y$ , 所以当 $\Delta y \rightarrow 0$ , 意味着 $f(x) \rightarrow f(x_0)$

#### ○ $\varepsilon - \delta$ 表示法

$f(x)$ 在点 $x_0$ 处连续 $\Leftrightarrow \forall \varepsilon > 0, \exists \delta > 0$ , 使得当 $|x - x_0| < \delta$ 时, 有 $|f(x) - f(x_0)| < \varepsilon$

#### ○ 左右连续

左连续

如果 $\lim_{x \rightarrow x_0^-} f(x) = f(x_0^-)$ 存在, 且等于 $f(x_0)$ , 那么就说函数 $f(x)$ 在点 $x_0$ 处左连续

右连续

如果 $\lim_{x \rightarrow x_0^+} f(x) = f(x_0^+)$ 存在, 且等于 $f(x_0)$ , 那么就说函数 $f(x)$ 在点 $x_0$ 处右连续

#### ○ 连续的三个条件

■ 函数在 $x_0$ 有定义

■ 函数当 $x \rightarrow x_0$ 的极限存在

■ 函数值与极限值相等

#### ○ 连续的几何意义

■ 函数图像在 $x_0$ 的某一邻域内, 是连成一片的, 没有跳跃, 空洞或断裂

■ 可以从左到右画过 $x_0$ 点, 不需要抬笔

#### ● 在区间上连续

在区间上每个点都连续的函数, 叫做在该区间上的连续函数

如果区间包括端点, 则说, 在左端点上连续, 指的是右连续, 在右端点上连续, 指的是左连续

#### ○ 几何意义

■ 区间上连续的函数的图像, 是一条连续而不间断的曲线

#### ● 函数的间断点

设函数 $f(x)$ 在点 $x_0$ 的某一去心邻域内有定义, 在此前提下, 如果函数 $f(x)$ 有下述情况之一, 则函数 $f(x)$ 在点 $x_0$ 处不连续, 点 $x_0$ 称为函数 $f(x)$ 的不连续点或间断点

○ 在 $x = x_0$ 处无定义

○ 在 $x = x_0$ 处虽有定义, 但极限 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x)$ 不存在

- 在  $x = x_0$  处虽有定义, 且极限  $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x)$  虽存在, 但极限值不等于函数值, 也即

$$\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) \neq f(x_0)$$

#### 间断点分类

- 第一类间断点, 左右极限存在, 但不满足连续性条件
  - 可去间断点, 指的是左右极限存在且相等, 但函数值未定义或不等于极限, 可通过重新定义函数在该点的值来消除不连续
    - $y = \frac{x^2-1}{x-1}$ , 在点  $x = 1$  无定义, 左右极限存在且相等, 因此可以补充定义, 消除不连续, 所以点  $x = 1$  是  $y = \frac{x^2-1}{x-1}$  的可去间断点
  - 跳跃间断点, 指的是左右极限存在, 但不相等, 函数值可以定义也可以未定义
    - $f(x) = \begin{cases} x-1, & x < 0, \\ 0, & x = 0, \\ x+1, & x > 0. \end{cases}$  在点  $x = 0$  处左右极限存在但不相等, 且产生了跳跃现象, 因此  $x = 0$  是  $f(x)$  的跳跃间断点
- 第二类间断点, 除了第一类的间断点外都称为第二类间断点, 也即左右极限至少一个不存在
  - 无穷间断点, 左右极限中至少一个趋于无穷
    - $y = \tan(x)$ , 点  $x = \frac{\pi}{2} + k\pi \ k \in \mathbb{Z}$  是  $y = \tan(x)$  的无穷间断点
  - 震荡间断点, 左右极限不存在, 且函数无限震荡
    - $y = \sin(\frac{1}{x})$ , 点  $x = 0$  是函数的震荡间断点, 因为在  $x = 0$  处无定义, 且函数值在  $[-1, 1]$  之间无限震荡

## 9. 连续函数的运算与初等函数的连续性

### 连续函数的和/差/积/商的连续性

设函数  $f(x)$  和  $g(x)$  在点  $x_0$  处连续, 则他们的和差  $f \pm g$ , 积  $f \times g$ , 商  $\frac{f}{g}(g(x_0) \neq 0)$  也都在点  $x_0$  处连续

### 反函数和复合函数的连续性

#### 反函数的连续性

如果函数  $f(x)$  在区间  $I$  上单调递增或递减, 且连续, 那么其反函数  $f^{-1}(x)$  在对应的区间  $I_y = \{y | y = f(x), x \in I\}$  上单调递增或递减, 且连续

#### 连续的复合函数求极限

设函数  $y = f[g(x)]$  是由函数  $u = g(x)$  和  $y = f(u)$  复合而来,  $\overset{\circ}{U}(x_0) \subset I_{f \circ g}$ , 若  $\lim_{x \rightarrow x_0} g(x) = u_0$ , 而函数  $y = f(u)$  在  $u = u_0$  处连续, 则有

$$\lim_{x \rightarrow x_0} f[g(x)] = \lim_{u \rightarrow u_0} f(u) = f(u_0)$$

说明对连续的复合函数求极限时, 可以做代换  $u = g(x)$ , 那么复合函数求极限就变换为了求  $\lim_{u \rightarrow u_0} f(u)$ , 其中  $u = u_0$

或

$$\lim_{x \rightarrow x_0} f[g(x)] = f[\lim_{x \rightarrow x_0} g(x)]$$

说明对连续的符合函数求极限时，函数符号 $f$ 可以与连续符号 $\lim_{x \rightarrow x_0}$ 做交换

- 复合函数连续性传导

设函数 $y = f[g(x)]$ 是由函数 $u = g(x)$ 和 $y = f(u)$ 复合而来， $U(x_0) \subset I_{f \circ g}$ ，若函数 $g(x)$ 在 $x = x_0$ 处连续，且 $u_0 = g(x_0)$ ，而函数 $y = f(u)$ 在 $u = u_0$ 处连续，则有复合函数 $y = f[g(x)]$ 在 $x = x_0$ 处连续

- 初等函数的连续性

基本初等函数，在其定义域内，都是连续的

一切初等函数，在其定义区间内，都是连续的

## 10. 闭区间上连续函数的性质

- 函数在闭区间上连续

函数在开区间 $(a, b)$ 内连续，在右端点 $b$ 左连续，在左端点 $a$ 右连续，则说函数在闭区间 $[a, b]$ 上连续

### 10.1 有界性与最大值、最小值定理

- 最大值、最小值概念

设函数 $f(x)$ 在区间 $I$ 上有定义，如果有 $x_0 \in I$ ，对于任一 $x \in I$ 都有

$f(x) \leq f(x_0)$ ，则称 $f(x_0)$ 是函数在区间 $I$ 上的最大值

$f(x) \geq f(x_0)$ ，则称 $f(x_0)$ 是函数在区间 $I$ 上的最小值

- 根据定义，线性函数在开区间 $(a, b)$ 内是没有最大值、最小值的，因为可以无限趋近于端点找到任一小的或者大的值

- 有界性与最值定理

在闭区间上连续的函数，在该闭区间上有界，且一定能取到该函数的最大值和最小值

- 注意：

- 闭区间上连续，意味着没有任何间断点
- 如果在开区间内连续，或在闭区间上有间断点，那么函数在该区间不一定有界，也不一定有最大值、最小值
  - $y = \tan(x)$ 在开区间 $(-\frac{\pi}{2}, \frac{\pi}{2})$ 内连续，但函数在该开区间内无界，且无最大值、最小值
  - $y = \begin{cases} -x + 1, & 0 \leq x < 1, \\ 1, & x = 1, \\ -x + 3, & 1 < x \leq 2. \end{cases}$ 在闭区间 $[0, 2]$ 上有间断点 $x = 1$ ，因此虽然该函数在闭区间 $[0, 2]$ 上有界，但是没有最大值最小值

### 10.2 零点定理与介值定理

- 零点定理

设函数 $f(x)$ 在闭区间 $[a, b]$ 上连续，且 $f(a)$ 和 $f(b)$ 异号，也即 $f(a) \cdot f(b) < 0$ ，在开区间 $(a, b)$ 内，至少有一个点 $\xi$ ，使得 $f(\xi) = 0$

- 介值定理

设函数 $f(x)$ 在闭区间 $[a, b]$ 上连续, 且 $f(a) \neq f(b)$ , 若 $f(a) = A$ ,  $f(b) = B$ , 则对于 $A$ 与 $B$ 之间的任一个数 $C$ , 在开区间 $(a, b)$ 内, 至少有一个点 $\xi$ , 使得 $f(\xi) = C$ , ( $a < \xi < b$ )

- 推论

在闭区间上连续的函数 $f(x)$ 的值域, 为闭区间 $[m, M]$ , 其中,  $m$ 与 $M$ 依次是函数 $f(x)$ 在闭区间 $[a, b]$ 上的最小值和最大值

## 10.3 一致连续性

- 一致连续性

设函数 $f(x)$ 在区间 $I$ 上有定义, 如果对于任意给定的正数 $\varepsilon$ , 总存在正数 $\delta$ , 使得对于区间 $I$ 上任意两点 $x_1, x_2$ , 当 $|x_1 - x_2| < \delta$ 时, 有 $|f(x_1) - f(x_2)| < \varepsilon$ , 那么称函数 $f(x)$ 在区间 $I$ 上一致连续

- 一致连续时,  $\delta$ 只与任意给定的 $\varepsilon$ 有关, 而与具体的点无关
  - 一致连续是普通连续的加强形式
  - 一致连续性表明, 函数的连续性在整个区间上是均匀的, 也即, 函数值的变化不会因为某些点的位置而变得过于激烈
- 普通连续时,  $\delta$ 不仅与任意给定的 $\varepsilon$ 有关, 还与具体的点 $x_0$ 有关

- 一致连续性定理

如果函数 $f(x)$ 在闭区间 $[a, b]$ 上连续, 那么它在该区间上一致连续

- 函数的Lipschitz条件-利普希茨条件

设函数 $f(x)$ 对于闭区间 $[a, b]$ 上任意两点 $x_1, x_2$ , 恒有 $|f(x_1) - f(x_2)| < L|x_1 - x_2|$ , 其中 $L$ 为正常数, 则函数 $f(x)$ 在闭区间 $[a, b]$ 上连续, 其实一致连续



→ 函数的 Lipschitz 条件 → 一致连续

6. 设  $f(x)$  对区间  $[a, b]$  上任意两点  $x, y$  恒有  $|f(x) - f(y)| \leq L|x - y|$ .

$L$  为正常数, 且  $f(a) \cdot f(b) < 0$ . 证: 至少有一点  $\xi \in (a, b)$  有  $f(\xi) = 0$ .

证: 任取  $\varepsilon \in (a, b)$ .  $\forall \varepsilon > 0$ . 取  $\delta = \min\{\frac{\varepsilon}{L}, x_0 - a, b - x_0\}$ .

$\delta$  取这么小的原因:

当  $x_0$  趋近  $a$  或  $b$  如果只取  $\frac{\varepsilon}{L}$ , 会导致超出定义域.  
则由定义可知, 当  $|x - x_0| < \delta$  时, 有

$$|f(x) - f(x_0)| \leq L|x - x_0| < L\delta$$

考察  $L\delta$  与  $\varepsilon$  的关系:

若  $\delta$  取  $\frac{\varepsilon}{L}$ , 则  $L\delta = \varepsilon$ .

若  $\delta$  不取  $\frac{\varepsilon}{L}$ , 则  $L\delta < L \cdot \frac{\varepsilon}{L} = \varepsilon$ .

$$\therefore |f(x) - f(x_0)| \leq L|x - x_0| < L\delta \leq \varepsilon.$$

$\therefore f(x)$  在  $x_0$  连续. 又  $\because x_0$  的任意性.  $\therefore f(x)$  在  $(a, b)$  内连续.

当  $x_0 = a$  或  $x_0 = b$ . 取  $\delta = \frac{\varepsilon}{L}$ . 则  $x \in [a, a + \delta)$  或  $(b - \delta, b]$

$$\text{则 } |f(x) - f(a)| \leq L|x - a| < L\delta = \varepsilon.$$

$x_0 = b$  同理.

$\therefore f(x)$  在  $a$  和  $b$  上连续.  $\therefore f(x)$  在  $[a, b]$  连续.

$\therefore$  零点定理可证至少有一点  $\xi$ , 使  $f(\xi) = 0$ .  $\xi \in (a, b)$