

测度与积分 教学讲义

讲课教材: **Real Analysis**, E.M.Stein & R. Shakarchi 编著, 普林斯顿大学出版2005.

参考书: 《实变函数论》和《实变函数解题指南》周民强, 北大出版社;

《实分析与复分析》[美] W.Rudin, 有中译本.

清华大学数学科学系本科教学 卢旭光 Feb. 2018

讲义目录

引言

第一章 \mathbb{R}^d 上的测度论

§1.1. 集合与映射, 集合的特征函数

§1.2. \mathbb{R}^d 中开集的结构

§1.3. 广义实数运算

§1.4. Lebesgue外测度和测度

§1.5. 连续变换下集合的可测性和测度估计

§1.6. 不可测集的存在性

§1.7. Vitali 覆盖引理

§1.8. 可测函数和简单函数逼近

§1.9. 可测函数列的收敛和Lusin 定理

第二章 积分理论

§2.1. 非负可测函数的积分

§2.2. 一般可测函数的积分

§2.3. Riemann积分与Lebesgue积分的关系

§2.4. 简单的积分换元公式和Newton-Leibnitz 公式

§2.5. 连续函数逼近, 积分的平均连续性

§2.6. 重积分和累次积分, Fubini定理

§2.7. L^1 -函数的Fourier 变换和Fourier反演公式

§2.8. 积分换元公式

第三章 微分与积分

§3.1. 积分的微分

§3.2. 函数的微分, 单调函数

§3.3. 有界变差函数

§3.4. 绝对连续函数

第四章 Hilbert空间简介, L^2 上Fourier 变换

第五章 一般测度与积分理论.

引言

我们在数学分析课程中已对Riemann积分与Lebesgue 积分的共性和各自的特点做了简要说明, 那里已揭示了现代积分的某些一般性, 为教学需要这里我们再重复一下: 以重积分和有界函数为例. 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 是一个有界区域, 函数 $f(x)$ 在 E 上有定义且有界.

Riemann 积分: 作 E 的分划和 E 上的 **Riemann 和**:

$$E = E_1 \cup E_2 \cup \cdots \cup E_n = \bigcup_{k=1}^n E_k, \quad E_k \text{ 是小区域, 互不重叠,}$$
$$\sum_{k=1}^n f(\xi_k) m(E_k), \quad \xi_k \in E_k; \quad \text{这里 } m(E_k) = E_k \text{ 的 } d \text{ 维体积.}$$

函数 f 在 E 上 Riemann 可积是说: 存在一个数, 记作 $\int_E f(x) dx$, 使得

$$\text{当 } \lim_{n \rightarrow \infty} \max_{1 \leq k \leq n} \text{diam}(E_k) = 0 \text{ 时 } \lim_{n \rightarrow \infty} \sup_{\xi_k \in E_k, 1 \leq k \leq n} \left| \sum_{k=1}^n f(\xi_k) m(E_k) - \int_E f(x) dx \right| = 0.$$

根据这个定义, 我们知道这等价于

$$\text{当 } \lim_{n \rightarrow \infty} \max_{1 \leq k \leq n} \text{diam}(E_k) = 0 \text{ 时 } \lim_{n \rightarrow \infty} \sup_{\xi_k \in E_k, 1 \leq k \leq n} \sum_{k=1}^n \omega(f, E_k) m(E_k) = 0$$

其中 $\omega(f, E_k)$ 是 f 在 E_k 上的振幅:

$$\omega(f, E_k) = \sup_{x, y \in E_k} |f(x) - f(y)|, \quad k = 1, 2, \dots, n.$$

于是可见: 有界函数 f 在 E 上 Riemann 可积, 当且仅当 f 在 E 上“几乎处处”连续.

Lebesgue 积分: 按 f 的函数值的分布对 E 作分划: 设 $a \leq f(x) < b, x \in E$,

$$E = \bigcup_{k=1}^n E_k, \quad E_k = \left\{ x \in E \mid a + (k-1) \frac{b-a}{n} \leq f(x) < a + k \frac{b-a}{n} \right\}.$$

令

$$\underline{L}_n(f) = \sum_{k=1}^n \left(a + (k-1) \frac{b-a}{n} \right) m(E_k), \quad \overline{L}_n(f) = \sum_{k=1}^n \left(a + k \frac{b-a}{n} \right) m(E_k)$$

则有

$$0 \leq \overline{L}_n(f) - \underline{L}_n(f) = \frac{b-a}{n} \sum_{k=1}^n m(E_k) = \frac{b-a}{n} m(E) \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty)$$

这里用到可加性质

$$\sum_{k=1}^n m(E_k) = m\left(\bigcup_{k=1}^n E_k\right) = m(E).$$

于是可见存在实数, 记作 $\int_E f(x)dx$, 使得

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \overline{L}_n(f) = \lim_{n \rightarrow \infty} \underline{L}_n(f) = \int_E f(x)dx$$

由此可见

$$\sup_{a+(k-1)\frac{b-a}{n} \leq y_k < a+k\frac{b-a}{n}} \left| \sum_{k=1}^n y_k m(E_k) - \int_E f(x)dx \right| \leq \frac{b-a}{n} m(E) \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty).$$

因此 f 在 E 上可积, 其积分近似值为 **Lebesgue 和**: $\sum_{k=1}^n y_k m(E_k)$. 在这个推导中我们唯一要求的是 f 能使诸集合 E_1, E_2, \dots, E_n 具有可加性.

.....
事实上经典的Lebesgue 测度与积分已包含了现代测度与积分的主要思想和理论框架。同学们在一年后会看到很多数学分支如泛函分析、动力系统、PDE、几何分析、分形理论, 尤其概率论随机过程都广泛使用现代测度与积分。将来学习随机过程时大家更将看到, 所有问题所有理论都是测度论的, 且多涉及更复杂的测度包括无穷维空间上的测度。甚至在数论研究中也用到测度论。为什么测度论的应用如此广泛? 我想主要是因为以下三点:

- 在现代测度论中“几乎所有”集合都是可测的, 并且测度空间都是完备的或都是容易完备化的, 这使得其中“几乎所有”极限运算都是封闭的。事实上上世纪七十年代数学家索罗威证明了不可测集的存在(差不多)等价于选择公理。[此处顺便说一句, 积分也可看成是测度。]

- 现代测度论是一种柔性技术, 即它可以研究结构很坏的集合, 能渗透到一些重要细节中。这归功于它的普适性和一些强大的定理, 而古典积分则要么无法研究很差的集合, 要么只能做形式运算而无法用于严格证明。

- 测度与积分主要用于处理平均行为和大范围性质, 自然界和科学中的问题也往往与个体的群体行为有关, 包括微观大宏观小的介观问题。一方面, 在我们还没有足够的精准技术去跟踪和研究个体问题时, 先研究群体行为就是自然的可行的, 另一方面, 即便每个个体行为清楚了, 也远不能代替对它们的群体行为的研究, 即仍需要研究群体行为。例如按照牛顿力学, 单个质点的运动服从牛顿定律, 是可逆的, 即可以沿反向回到初态, 但一般来说质点群体的运动行为就不可逆了。

现代测度与积分已构成了一个完整体系, 操作方式都是有章可循的, 也是比较直观的, 我们的学生在学习上一般没有大的障碍, 只是开始不习惯一些集合运算, 包括对积分区域的适当分解等, 同学们务必多动手演练。

教材和参考书:

教材: **Real Analysis**, E.M.Stein & R. Shakarchi 编著, 普林斯顿大学出版2005

参考书:

[1] 周民强《实变函数》, 北京大学出版社。此书主要讲经典 Lebesgue 测度和积分, 习题丰富有趣 (90 年代以后的各版本有部分习题解答), 适于作本科生实分析教材。

[2] W. Rudin *Real and Complex Analysis* (《实分析与复分析》)有中译本, 人民教育出版社, 1981. 此书为名著, 其实分析部分包括了现代测度与积分的主要方法和结果, 适于数学系高年级学生和研究生学习。

[3] Gerald B. Folland *Real Analysis: Modern Techniques and Their Applications*, Jon Wiley & Sons, Inc. , 1984. 该书比较浓缩但是非常清晰地展示了现代测度和积分的基本知识, 使读者能较快地领略并掌握这门学科的主干和应用方法。

[4] 严加安《测度论讲义》(第二版), 科学出版社, 2004. 此书较全面也较浓缩, 是研究测度论和概率论学者的必读教材。

[5] A. Mukherjea and K. Pothoven, *Real and Functional Analysis, Part A: Real Analysis*, Second Edition, 1984, Plenum Press, New York. 此书技术含量较高。

第一章 \mathbb{R}^d 上的测度论

§1.1. 集合与映射, 集合的特征函数

• 集合的运算.

以下出现的大写字母 A, B, C, A_i, X 等都表示集合.

1° **子集**: 若 A 的元素都在 B 中, 则称 A 是 B 的一个子集, 记作 $A \subset B$ 或 $B \supset A$. 因此

$$(A \subset B) \iff (x \in A \implies x \in B).$$

2° **相等**: A 与 B 相等的定义为

$$(A = B) \iff (x \in A \iff x \in B) \iff (A \subset B \text{ and } B \subset A).$$

若 A, B 不相等, 则记为 $A \neq B$.

注意: 等号 (不等号) 两边的东西是地位相等的, 即

$$A = B \iff B = A, \quad A \neq B \iff B \neq A.$$

3° **并集**: 由 A, B 两集合的元素的全体组成的集合记作 $A \cup B$, 称为 A 与 B 的并集. 即

$$A \cup B := \{x \mid x \in A \text{ 或 } x \in B\}. \quad \text{显然 } A \cup B = B \cup A.$$

一般地任意多个集合 $A_\alpha (\alpha \in I)$ 的, 元素的全体组成的集合记作 $\bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha$, 称为诸 A_α 的并集, 即

$$\bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha := \{x \mid \exists \alpha \in I \text{ s.t. } x \in A_\alpha\}.$$

4° **交集**: 由 A, B 两集合的公共元素的全体组成的集合记作 $A \cap B$, 称为 A 与 B 的交集. 即

$$A \cap B := \{x \mid x \in A \text{ 且 } x \in B\}. \quad \text{易见 } A \cap B = B \cap A.$$

一般地任意多个集合 $A_\alpha (\alpha \in I)$ 的公共元素的全体组成的集合记作 $\bigcap_{\alpha \in I} A_\alpha$, 称为诸 A_α 的交集, 即

$$\bigcap_{\alpha \in I} A_\alpha := \{x \mid \forall \alpha \in I, x \in A_\alpha\}.$$

5° 并、交运算的结合律和交换律:

$$(A \cup B) \cup C = A \cup (B \cup C), \quad (A \cap B) \cap C = A \cap (B \cap C).$$

【证】略.

6° 并、交运算的两个分配律:

$$A \cap (B \cup C) = (A \cap B) \cup (A \cap C), \quad A \cup (B \cap C) = (A \cup B) \cap (A \cup C).$$

一般地

$$A \cap \bigcup_{\alpha \in I} B_{\alpha} = \bigcup_{\alpha \in I} A \cap B_{\alpha}, \quad A \cup \bigcap_{\alpha \in I} B_{\alpha} = \bigcap_{\alpha \in I} A \cup B_{\alpha}.$$

【证】只证明最后两个等式.

$$\begin{aligned} x \in A \cap \bigcup_{\alpha \in I} B_{\alpha} &\iff x \in A \text{ and } x \in \bigcup_{\alpha \in I} B_{\alpha} \iff x \in A \text{ and } \exists \alpha \in I \text{ s.t. } x \in B_{\alpha} \\ &\iff \exists \alpha \in I \text{ s.t. } x \in A \cup B_{\alpha} \iff x \in \bigcup_{\alpha \in I} A \cup B_{\alpha}. \end{aligned}$$

所以两集合相等. 对最后那个等式, 我们有

$$\forall \alpha \in I, \quad A \subset A \cup B_{\alpha} \implies A \subset \bigcap_{\alpha \in I} A \cup B_{\alpha}.$$

而显然

$$\bigcap_{\alpha \in I} B_{\alpha} \subset \bigcap_{\alpha \in I} A \cup B_{\alpha}.$$

所以

$$A \cup \bigcap_{\alpha \in I} B_{\alpha} \subset \bigcap_{\alpha \in I} A \cup B_{\alpha}.$$

反之, 设 $x \in \bigcap_{\alpha \in I} A \cup B_{\alpha}$. 若 $x \in A$, 则自然 $x \in A \cup \bigcap_{\alpha \in I} B_{\alpha}$. 若 $x \notin A$, 则由交集定义, 对任意 $\alpha \in I$ 有 $x \in A \cup B_{\alpha}$ 从而有 $x \in B_{\alpha}$. 因此 $x \in \bigcap_{\alpha \in I} B_{\alpha}$. 所以仍有 $x \in A \cup \bigcap_{\alpha \in I} B_{\alpha}$. 因此

$$\bigcap_{\alpha \in I} A \cup B_{\alpha} \subset A \cup \bigcap_{\alpha \in I} B_{\alpha}.$$

因此两集合相等. \square

7° 差集: 把 A 中属于 B 的元素去掉, 剩下的元素构成的集合称为 A 减 B 后的差集, 记作 $A \setminus B$, 即

$$A \setminus B := \{x \in A \mid x \notin B\}.$$

8° **余集 (或补集)**: 设 X 是我们所考虑的一个大集合. 对任意 $A \subset X$, 我们把差集 $X \setminus A$ 叫做 A 关于 X 的补集或余集, 记作

$$A^c := X \setminus A.$$

这里上标 c 提示 “补” 或 “余” (complement). 易见当 $A, B \subset X$ 时 有

$$(A^c)^c = A, \quad A = B \iff A^c = B^c.$$

9° **用补集表示差集**: 设 $A, B \subset X$. 则

$$A \setminus B = A \cap B^c = B^c \cap A.$$

【证】由 $A, B \subset X$ 和交集运算交换律有

$$A \setminus B = \{x \in A \mid x \in X \setminus B\} = A \cap (X \setminus B) = A \cap B^c = B^c \cap A.$$

10° **de Morgan 对偶原理**: 设 A, B 为 X 的子集. 则

$$(A \cup B)^c = A^c \cap B^c, \quad (A \cap B)^c = A^c \cup B^c.$$

一般地, 设 $A_\alpha \subset X$ ($\forall \alpha \in I$). 则

$$\left(\bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha\right)^c = \bigcap_{\alpha \in I} A_\alpha^c, \quad \left(\bigcap_{\alpha \in I} A_\alpha\right)^c = \bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha^c.$$

也即 “并的补等于补的交”, “交的补等于补的并”. 用差集表示则写成

$$X \setminus \bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha = \bigcap_{\alpha \in I} (X \setminus A_\alpha), \quad X \setminus \bigcap_{\alpha \in I} A_\alpha = \bigcup_{\alpha \in I} (X \setminus A_\alpha).$$

【证】

$$\begin{aligned} x \in \left(\bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha\right)^c &\iff x \in X \text{ and } x \notin \bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha \iff x \in X \text{ and } \forall \alpha \in I, x \notin A_\alpha \\ &\iff \forall \alpha \in I, x \in X \setminus A_\alpha \iff x \in \bigcap_{\alpha \in I} (X \setminus A_\alpha) = \bigcap_{\alpha \in I} A_\alpha^c. \end{aligned}$$

所以第一个恒等式成立. 利用这一恒等式得到

$$\left(\bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha^c\right)^c = \bigcap_{\alpha \in I} (A_\alpha^c)^c = \bigcap_{\alpha \in I} A_\alpha. \quad \text{因此} \quad \left(\bigcap_{\alpha \in I} A_\alpha\right)^c = \bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha^c.$$

□

• **集合的乘积 (笛卡尔积或直积).** 设 X, Y 为任意两个集合. 定义新的集合

$$X \times Y := \{(x, y) \mid x \in X, y \in Y\}.$$

在 $X \times Y$ 中规定两元素相等为

$$(x_1, y_1) = (x_2, y_2) \iff x_1 = x_2, y_1 = y_2.$$

称 $X \times Y$ 为集合 X, Y 的乘积, 也称为笛卡尔积或直积.

一般地, 设 X_1, X_2, \dots, X_n 为任意 n 个集合. 定义它们的乘积 (笛卡尔积) 为

$$X_1 \times X_2 \times \cdots \times X_n := \{(x_1, x_2, \dots, x_n) \mid x_i \in X_i, i = 1, 2, \dots, n\}.$$

在 $X_1 \times X_2 \times \cdots \times X_n$ 中规定两元素相等为

$$(x_1, x_2, \dots, x_n) = (y_1, y_2, \dots, y_n) \iff x_i = y_i, i = 1, 2, \dots, n.$$

当 $X_1 = X_2 = \cdots = X_n = X$ 时简记

$$\underbrace{X \times X \times \cdots \times X}_n = X^n.$$

例如

$$X^2 = X \times X, \quad \mathbb{N}^3 = \mathbb{N} \times \mathbb{N} \times \mathbb{N}, \quad \text{等等}.$$

乘积的结合律: 对于 $X_1 \times X_2 \times \cdots \times X_n$ 中的元素我们规定括号运算: 例如

$$((x_1, x_2, \dots, x_{n-1}), x_n) = (x_1, (x_2, x_3, \dots, x_n)) = (x_1, x_2, \dots, x_n),$$

$$((x_1, x_2, \dots, x_k), x_{k+1}, \dots, x_n) = \cdots = (x_1, x_2, \dots, x_{n-k}, (x_{n-k+1}, \dots, x_n)) = (x_1, x_2, \dots, x_n),$$

等等, 其中括号内的元素组自然看成是相应的部分乘积集的元素. 于是有结合律:

$$(X_1 \times X_2 \times \cdots \times X_{n-1}) \times X_n = X_1 \times (X_2 \times X_3 \times \cdots \times X_n) = X_1 \times X_2 \times \cdots \times X_n,$$

$$(X_1 \times X_2 \times \cdots \times X_k) \times X_{k+1} \times \cdots \times X_n = \cdots$$

$$= X_1 \times X_2 \times \cdots \times X_{n-k} \times (X_{n-k+1} \times \cdots \times X_n) = X_1 \times X_2 \times \cdots \times X_n.$$

等等. 这个结合律的主要作用之一在于人们可以对集合 X_1, X_2, \dots, X_n 的个数 n 运用数学归纳法来证明乘积集合 $X_1 \times X_2 \times \cdots \times X_n$ 的某些性质.

• **乘积集合的本质.** 以 $X \times Y$ 为例. $X \times Y$ 的元素 (x, y) 的分量 x 和 y , 除了它们的顺序 (x 为第一分量, y 为第二分量) 被人为规定外, 是**彼此独立的**, 即一方的变化范围和属性与另一方无关. 至于 x, y 的顺序要求, 则完全是为了明确分量的位置和身份. 当然, 由于这种顺序的缘故, x 与 y 的地位就不是对称的: x 在第一位置, y 在第二位置.

很多时候, 顺序也是不得已而为之的, 也即我们无法做到全面均衡或对称. 例如为了给同等级别的嘉宾安排座位, 可以采用圆桌排位, 但在书写或宣布嘉宾名字的时候, 就不得不有先后之分(通常采用以姓氏为序的天然顺序). 这也说明了我们的空间和时间在很多情况下不得不是有区别的、有序的.

乘积集合的“乘积”这个叫法来自于矩形面积和长方体的体积的计算方式. 例如矩形(二维乘积集合)

$$[a_1, b_1] \times [a_2, b_2] = \{(x_1, x_2) \mid x_1 \in [a, b], x_2 \in [c, d]\}$$

的面积 S 即为相邻边长的乘积: $S = (b - a)(d - c)$.

长方体(三维乘积集合)

$$[a_1, b_1] \times [a_2, b_2] \times [a_3, b_3] = \{(x_1, x_2, x_3) \mid x_i \in [a_i, b_i], i = 1, 2, 3.\}$$

的体积 V 即为相邻棱长的乘积: $V = (b_1 - a_1)(b_2 - a_2)(b_3 - a_3)$.

当然, 由乘积集合的定义易见很多集合不是乘积型的.

• 函数与映射

映射的概念: 设 X, Y 为两个集合. 如果按照某个确定规律 f , 对每个 $x \in X$, 存在唯一的元素 $y \in Y$ 与 x 对应, 则说 f 是定义在 X 上而在 Y 中取值的映射. 这时我们称集合 X 为映射 f 的定义域或出发域, 它的一般元素 x 称为映射 f 的变元或自变量, 而由 x 通过 f 对应的元素 y 记作 $f(x)$, 即 $y = f(x)$, 并称 $y = f(x)$ 是 f 的因变量. 我们把此事记作

$$f : X \rightarrow Y, \quad x \mapsto f(x).$$

于是记号 $f : X \rightarrow Y$ (读作 f 是从 X 到 Y 的映射或 f 把 X 映入 Y) 就表示:

(1) $x \in X \implies f(x) \in Y$.

$$(2) x_1 = x_2 \in X \implies f(x_1) = f(x_2).$$

此时我们称集合

$$f(X) := \{y \in Y \mid \exists x \in X \text{ s.t. } y = f(x)\} = \{f(x) \mid x \in X\}$$

为映射 f 的值域, 或到达域, 或象集. 当 Y 为数集时, 如 Y 是实数集合或复数集合的子集, 也称映射 f 为函数. 现代数学中无论 Y 是否为数集, 人们有时也把映射叫做函数.

设 $f: X \rightarrow Y, g: X \rightarrow Y$. 若 $x \in X \implies f(x) = g(x)$, 则成 f 与 g 相等, 或称 f, g 为同一个映射. \square

纵观整个数学领域, 可以说

最基本最常用最重要的东西就是映射(函数、变换)及其表示.

映射的例子: 随堂给出.....

• **映射的象集和逆象集.** 设 $f: X \rightarrow Y, A \subset X, B \subset Y$. 称

$$f(A) := \{y \in Y \mid \exists x \in A \text{ s.t. } y = f(x)\} = \{f(x) \mid x \in A\}$$

为 A 在 f 下的象集; 而称

$$f^{-1}(B) := \{x \in X \mid f(x) \in B\}$$

为 B 在 f 下的原象集或逆象集. 对于空集 \emptyset , 显然有 $f(\emptyset) = \emptyset, f^{-1}(\emptyset) = \emptyset$.

易见下列包含关系成立:

$$A_1 \subset A_2 \subset X \implies f(A_1) \subset f(A_2) \subset Y,$$

$$B_1 \subset B_2 \subset Y \implies f^{-1}(B_1) \subset f^{-1}(B_2) \subset X.$$

此外, 由映射的定义还易见下面包含关系成立:

$$A \subset f^{-1}(f(A)), \quad f(f^{-1}(B)) \subset B.$$

【例】 设 $f(x) = \sin x, x \in \mathbb{R}$. 则

$$f([0, \pi]) = [0, 1], \quad f^{-1}([0, \infty)) = f^{-1}([0, 1]) = \bigcup_{k \in \mathbb{Z}} [2k\pi, (2k+1)\pi].$$

这里 \mathbb{R} 表示全体实数的集合, \mathbb{Z} 表示全体整数的集合.

下面命题给出了映射的象集和逆象集的常用的基本关系式.

【命题1.1.1】对任一映射 $f: X \rightarrow Y$, 设一切 $A_\alpha \subset X$, 一切 $B_\alpha \subset Y$. 则有

$$\begin{aligned} f\left(\bigcup_{\alpha \in I} A_\alpha\right) &= \bigcup_{\alpha \in I} f(A_\alpha), \\ f\left(\bigcap_{\alpha \in I} A_\alpha\right) &\subset \bigcap_{\alpha \in I} f(A_\alpha) \quad (\text{当 } f \text{ 为单射时等号成立}), \\ f^{-1}\left(\bigcup_{\alpha \in J} B_\alpha\right) &= \bigcup_{\alpha \in J} f^{-1}(B_\alpha), \\ f^{-1}\left(\bigcap_{\alpha \in J} B_\alpha\right) &= \bigcap_{\alpha \in J} f^{-1}(B_\alpha). \end{aligned}$$

【证】只证第三个. 对任意 $x \in X$ 我们有

$$x \in f^{-1}\left(\bigcup_{\alpha \in J} B_\alpha\right) \iff f(x) \in \bigcup_{\alpha \in J} B_\alpha \iff \text{存在 } \beta \in J \text{ 使得 } f(x) \in B_\beta \iff \text{存在 } \beta \in J \text{ 使得 } x \in f^{-1}(B_\beta) \iff x \in \bigcup_{\alpha \in J} f^{-1}(B_\alpha). \quad \square$$

• 可数集与不可数集.

【定义】若集合 X 与自然数集合 \mathbb{N} 一一对应, 则称 X 是一个可数无限集. 空集、有限集和可数无限集统称为可数集. (为什么用“可数”这个名称?) 若集合 X 不是可数集, 则称 X 是不可数集, 或称 X 不可数. \square

在关于可数集的所有性质中, 下面命题中的性质是最常用也是最好用的. 我们将使用序列的概念

【序列的定义】. 设 X 是任意集合. 则任何映射 $f: \mathbb{N} \rightarrow X, n \mapsto f(n)$ 都叫做一个序列. 习惯上记这一序列为

$$\begin{aligned} a_n &= f(n) \quad (n \in \mathbb{N}) \quad \text{或} \quad \{a_n\} \quad \text{或} \quad \{a_n\}_{n \in \mathbb{N}} \quad \text{或} \quad \{a_n\}_{n=1}^\infty, \\ \text{或 } x_n &= f(n) \quad (n \in \mathbb{N}) \quad \text{或} \quad \{x_n\} \quad \text{或} \quad \{x_n\}_{n \in \mathbb{N}} \quad \text{或} \quad \{x_n\}_{n=1}^\infty, \quad \text{等等}. \end{aligned}$$

同时也称 $\{a_n\}_{n=1}^\infty$ 是一个序列, 并称 a_n 是此序列的第 n 项. \square

【命题1.1.0】(1) 设 $\{x_n\}_{n=1}^\infty$ 为任一序列. 则 $\{x_n\}_{n=1}^\infty$ 必然属于以下两种情形之一:

(I) 存在 $N \in \mathbb{N}$ 和自然数 $1 = n_1 < n_2 < \dots < n_N$, 使得 $x_{n_1}, x_{n_2}, \dots, x_{n_N}$ 互不相同, 而序列 $\{x_n\}_{n=1}^\infty$ 中的每一项 x_n 都属于 $\{x_{n_1}, x_{n_2}, \dots, x_{n_N}\}$, 从而有 $\{x_n\}_{n=1}^\infty = \{x_{n_1}, x_{n_2}, \dots, x_{n_N}\}$. 换言之, 此时序列 $\{x_n\}_{n=1}^\infty$ 作为集合是有限集.

(II) 存在 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ 的子序列 $\{x_{n_k}\}_{k=1}^{\infty}$, 其中 x_{n_k} 互不相同 (i.e. $i \neq j \implies x_{n_i} \neq x_{n_j}$) 使得序列 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ 中的每一项 x_n 都属于 $\{x_{n_1}, x_{n_2}, x_{n_3}, \dots\}$, 从而有 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty} = \{x_{n_1}, x_{n_2}, x_{n_3}, \dots\}$. 换言之, 此时序列 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ 作为集合是可数无限集.

(2) 若集合 X 的所有元素可以编号成一序列 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$, 则 X 是可数集. 【注意: x_n 不必互不相同.】

【证】易见(1)蕴含(2). 故只需证明(1). 假设 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ 不属于情形 (I). 我们来证明它必属于情形 (II). 注意在这个假设下, 下面出现的自然数的子集均非空, 从而都有最小元. 依次考虑最小元:

$$\begin{aligned} n_1 &= 1, \\ n_2 &= \min\{m \in \mathbb{N} \mid x_m \neq x_{n_1}\}, \\ n_3 &= \min\{m \in \mathbb{N} \mid x_m \notin \{x_{n_1}, x_{n_2}\}\}, \\ n_4 &= \min\{m \in \mathbb{N} \mid x_m \notin \{x_{n_1}, x_{n_2}, x_{n_3}\}\}, \\ &\dots\dots\dots \\ n_{k+1} &= \min\{m \in \mathbb{N} \mid x_m \notin \{x_{n_1}, x_{n_2}, \dots, x_{n_k}\}\}, \\ &\dots\dots\dots \end{aligned}$$

根据操作程序的归纳法原理, 上述程序对每个自然数 $k \in \mathbb{N}$ 都可施行.

易见上述集合有包含关系:

$$\{m \in \mathbb{N} \mid x_m \neq x_{n_1}\} \supset \{m \in \mathbb{N} \mid x_m \notin \{x_{n_1}, x_{n_2}\}\} \supset \{m \in \mathbb{N} \mid x_m \notin \{x_{n_1}, x_{n_2}, x_{n_3}\}\} \supset \dots.$$

故 $1 = n_1 \leq n_2 \leq n_3 \leq n_4 \leq \dots$. 但显然 x_{n_k} 互不相同从而 n_k 互不相同, 因此必有

$$1 = n_1 < n_2 < n_3 < n_4 < \dots.$$

这表明 $\{x_{n_k}\}_{k=1}^{\infty}$ 是 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ 的子列并且 x_{n_k} 互不相同. 注意 $n_k \geq k$ ($k = 1, 2, \dots$). 任取 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ 的一项 x_m . 取 $k > m - 1$. 则 $m < k + 1 \leq n_{k+1}$. 断言: $x_m \in \{x_{n_1}, x_{n_2}, \dots, x_{n_k}\}$. 否则, $x_m \notin \{x_{n_1}, x_{n_2}, \dots, x_{n_k}\}$, 则由 n_{k+1} 的定义应有 $n_{k+1} \leq m$, 这矛盾于 $m < n_{k+1}$. 这就证明了 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ 的每一项都属于 $\{x_{n_1}, x_{n_2}, x_{n_3}, \dots\}$. 因此作为集合我们有 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty} = \{x_{n_1}, x_{n_2}, x_{n_3}, \dots\}$. 因后者是可数无限集, 故 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ 作为集合是可数无限集. \square

【可数集的基本性质】

(1) 非空集合 X 是可数集当且仅当 X 的元素可以被编号：即

$$X = \{x_1, x_2, x_3, \dots\} \quad \text{当 } X \text{ 是可数无限集时};$$

$$X = \{x_1, x_2, x_3, \dots, x_n\} \quad \text{当 } X \text{ 是有限集时}.$$

(注意, 以上括号中的元素 x_k 互不相同, 即当 $i \neq j$ 时 $x_i \neq x_j$.)

(2) 可数集的子集还是可数集.

(3) 可数个可数集的并还是可数集, 即若 A_n 是可数集, $n = 1, 2, 3, \dots, N$ 或 $n \in \mathbb{N}$, 则 $\bigcup_{n=1}^N A_n$ 和相应地 $\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n$ 都是可数集.

(4) 有限多个可数集的乘积集还是可数集, 即若 X_1, X_2, \dots, X_N 都是可数集, 则 $X_1 \times X_2 \times \dots \times X_N$ 也是可数集.

【证】(1) 是明显的.

(2): 设 X 是可数集, $A \subset X$. 若 A 是有限集, 则 A 当然是可数集. 设 A 是无限集. 则由命题 1 (利用反证法) 知 X 也是无限集从而 X 是可数无限集. 因此可写 $X = \{x_1, x_2, x_3, \dots\}$. 令

$$\mathbb{N}_0 = \{k \in \mathbb{N} \mid x_k \in A\}.$$

则 \mathbb{N}_0 是 \mathbb{N} 的无限子集. 将 \mathbb{N}_0 的元素按大小排列为 $1 \leq n_1 < n_2 < n_3 < \dots$. 则有 $A = \{x_{n_1}, x_{n_2}, x_{n_3}, \dots\}$. 于是由 (1) 知 A 是可数集.

(3): 先假设有可数无限多个 A_n 且每个 A_n 都是可数无限集. 写

$$A_1 = \{a_{11}, a_{12}, a_{13}, a_{14}, \dots\},$$

$$A_2 = \{a_{21}, a_{22}, a_{23}, a_{24}, \dots\},$$

$$A_3 = \{a_{31}, a_{32}, a_{33}, a_{34}, \dots\},$$

$$A_4 = \{a_{41}, a_{42}, a_{43}, a_{44}, \dots\},$$

.....

按 45° 度角的斜线排法(给图示), 可以将所有元素 a_{ij} 排成一列:

$$a_{11}, \quad a_{12}, a_{21}, \quad a_{13}, a_{22}, a_{31}, \quad \dots \quad a_{1n}, a_{2(n-1)}, \dots, a_{i(n-i)}, \dots, a_{n1}, \quad \dots$$

于是可将 $\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n$ 的所有元素排成一个序列:

$$\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n = \{a_n^*\}_{n=1}^{\infty} \quad (\text{右边的元素中可能有重合者}).$$

据本节命题4知 $\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n$ 是可数集.

对于其他情形, 若只有有限多个集合 A_n , 则可以添加可数无限多个单点集使成为可数无限多个集合的情形; 而对于某个 A_n 为有限集的情形, 添加可数无限多个元素于 A_n 使其成为可数无限集. 因原来的集合的并集是改造后的集合的并集的子集, 故由上面结果知原来的并集也是可数集.

(4): 应用(有界)归纳法原理, 只需证 $N = 2$ 的情形. 设 X, Y 都是可数集. 先设 X, Y 都是可数无限集: $X = \{x_1, x_2, x_3, \dots\}, Y = \{y_1, y_2, y_3, \dots\}$. 令

$$A_k = \{(x_k, y_1), (x_k, y_2), (x_k, y_3), \dots\}, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

则每个 A_k 都与 Y 一一对应因而是可数无限集. 易见

$$X \times Y = \bigcup_{k=1}^{\infty} A_k$$

于是由刚证的性质(3) 知 $X \times Y$ 是可数无限集(无限是显然的).

同理可证当 X, Y 中一个为可数无限集, 另一个为有限集, 以及两个均为有限集时, $X \times Y$ 也都是可数集. \square

【例】有理数集 $\mathbb{Q} = \{\frac{m}{n} \mid m \in \mathbb{Z}, n \in \mathbb{N}\}$ 是可数集. 实数集 \mathbb{R} 是不可数集.

【证】令 $-\mathbb{N} = \{-n \mid n \in \mathbb{N}\}$, 则易见 $-\mathbb{N}$ 是可数集, 因此 $\mathbb{Z} = \mathbb{N} \cup \{0\} \cup (-\mathbb{N})$ 是可数集. 令

$$A_n = \left\{ \frac{m}{n} \mid m \in \mathbb{Z} \right\}, \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

则每个 A_n 都与 \mathbb{Z} 对等从而都是可数集. 易见 $\mathbb{Q} = \bigcup_{n=1}^{\infty} A_n$. 因此由可数集性质(3)知 \mathbb{Q} 是可数集.

对于“实数集 \mathbb{R} 是不可数集”的证明, 可以使用反证法和闭区间套定理等, 参见周民强的《实变函数论》 \square

• **集合的特征函数.** 设 X, A 为集合且 $A \subset X$. 定义二值函数 $\mathbf{1}_A: X \rightarrow \{0, 1\}$ 如下

$$\mathbf{1}_A(x) = \begin{cases} 1 & \text{if } x \in A, \\ 0 & \text{if } x \notin A. \end{cases}$$

注意: 当 $A = \emptyset$ 为空集时有 $\mathbf{1}_\emptyset(x) \equiv 0$. 一般地对任一性质 P , 也可定义

$$\mathbf{1}_{\{P\}} = \begin{cases} 1 & \text{if } P \text{ is true,} \\ 0 & \text{if } P \text{ is not true.} \end{cases}$$

例如

$$\mathbf{1}_{\{a < b\}} = \begin{cases} 1 & \text{if } a < b, \\ 0 & \text{if } a \geq b. \end{cases}$$

特征函数的基本性质:

(1) 设 X_i 为集合, $A_i \subset X_i, i = 1, 2, \dots, d$. 则

$$\mathbf{1}_{A_1 \times A_2 \times \dots \times A_d}(x_1, x_2, \dots, x_d) = \mathbf{1}_{A_1}(x_1)\mathbf{1}_{A_2}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{A_d}(x_d), \quad x_i \in X_i.$$

(2) 设 X 为集合并设下面出现的集合皆为 X 的子集. 则有

$$\mathbf{1}_{A^c}(x) = 1 - \mathbf{1}_A(x),$$

$$\mathbf{1}_{A \cup B}(x) = \mathbf{1}_A(x) + \mathbf{1}_B(x) - \mathbf{1}_{A \cap B}(x),$$

$$\mathbf{1}_{A \cup B}(x) = \mathbf{1}_A(x) + \mathbf{1}_B(x) \quad \text{if } A \cap B = \emptyset,$$

$$B \subset \bigcup_{i=1}^n A_i \implies \mathbf{1}_B(x) \leq \sum_{i=1}^n \mathbf{1}_{A_i}(x),$$

$$\mathbf{1}_{\bigcup_{i=1}^n A_i}(x) \leq \sum_{i=1}^n \mathbf{1}_{A_i}(x),$$

$$\mathbf{1}_{\bigcup_{i=1}^n A_i}(x) = \sum_{i=1}^n \mathbf{1}_{A_i}(x) \quad \text{if } A_i \cap A_j = \emptyset \quad \forall i \neq j,$$

$$\mathbf{1}_{A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_d}(x) = \mathbf{1}_{A_1}(x)\mathbf{1}_{A_2}(x) \cdots \mathbf{1}_{A_d}(x),$$

$$\mathbf{1}_{\bigcup_{i=1}^n A_i}(x) = 1 - \prod_{i=1}^n (1 - \mathbf{1}_{A_i}(x)),$$

$$\sum_{i=1}^n \mathbf{1}_{A_i}(x) \geq k \iff x \in A_{i_1} \cap A_{i_2} \cap \dots \cap A_{i_k} \text{ for some } i_1, i_2, \dots, i_k.$$

倒数第二个等式的推导如下: 考虑补集!! 我们有

$$1 - \mathbf{1}_{\bigcup_{i=1}^n A_i}(x) = \mathbf{1}_{(\bigcup_{i=1}^n A_i)^c}(x) = \mathbf{1}_{\bigcap_{i=1}^n A_i^c}(x) = \prod_{i=1}^n \mathbf{1}_{A_i^c}(x) = \prod_{i=1}^n (1 - \mathbf{1}_{A_i}(x)).$$

移项即得所证等式。当然你还可以进一步把右边展开...。

【集合与数的乘积公式】

【命题1.1.2(乘积公式).】

(a) 设 $E_{i,j}$ 为一些集合, $j = 1, 2, \dots, n_i$; $i = 1, 2, \dots, d$. 则有

$$\left(\bigcup_{j=1}^{n_1} E_{1,j}\right) \times \left(\bigcup_{j=1}^{n_2} E_{2,j}\right) \times \cdots \times \left(\bigcup_{j=1}^{n_d} E_{d,j}\right) = \bigcup_{j_1=1}^{n_1} \bigcup_{j_2=1}^{n_2} \cdots \bigcup_{j_d=1}^{n_d} E_{1,j_1} \times E_{2,j_2} \times \cdots \times E_{d,j_d}. \quad (1.1.1)$$

(b) 设 $a_{i,j}$ 为一些数, $j = 1, 2, \dots, n_i$; $i = 1, 2, \dots, d$. 则有

$$\left(\sum_{j=1}^{n_1} a_{1,j}\right) \left(\sum_{j=1}^{n_2} a_{2,j}\right) \cdots \left(\sum_{j=1}^{n_d} a_{d,j}\right) = \sum_{j_1=1}^{n_1} \sum_{j_2=1}^{n_2} \cdots \sum_{j_d=1}^{n_d} a_{1,j_1} a_{2,j_2} \cdots a_{d,j_d}. \quad (1.1.2)$$

【证】(1.1.1)可从集合相等的定义直接导出. 下证(1.1.2). 对 $a_{i,j}$ 的第一个下标 i 的个数 d 用归纳法. 当 $d = 1$ 时, (1.1.2) 自动成立. 假设在下标 i 的个数为 d 时(1.1.2)成立, 则在下标 i 的个数为 $d + 1$ 时, 令

$$A = \sum_{j=1}^{n_{d+1}} a_{d+1,j} = \sum_{j_{d+1}=1}^{n_{d+1}} a_{d+1,j_{d+1}}.$$

则有

$$a_{1,j_1} a_{2,j_2} \cdots a_{d,j_d} A = a_{1,j_1} a_{2,j_2} \cdots a_{d,j_d} \sum_{j_{d+1}=1}^{n_{d+1}} a_{d+1,j_{d+1}} = \sum_{j_{d+1}=1}^{n_{d+1}} a_{1,j_1} a_{2,j_2} \cdots a_{d,j_d} a_{d+1,j_{d+1}}.$$

由归纳假设便有

$$\begin{aligned} & \left(\sum_{j=1}^{n_1} a_{1,j}\right) \left(\sum_{j=1}^{n_2} a_{2,j}\right) \cdots \left(\sum_{j=1}^{n_{d+1}} a_{d+1,j}\right) = \left(\sum_{j=1}^{n_1} a_{1,j}\right) \left(\sum_{j=1}^{n_2} a_{2,j}\right) \cdots \left(\sum_{j=1}^{n_d} a_{d,j}\right) A \\ &= \sum_{j_1=1}^{n_1} \sum_{j_2=1}^{n_2} \cdots \sum_{j_d=1}^{n_d} a_{1,j_1} a_{2,j_2} \cdots a_{d,j_d} A \\ &= \sum_{j_1=1}^{n_1} \sum_{j_2=1}^{n_2} \cdots \sum_{j_d=1}^{n_d} \left(\sum_{j_{d+1}=1}^{n_{d+1}} a_{1,j_1} a_{2,j_2} \cdots a_{d+1,j_{d+1}} \right) = \sum_{j_1=1}^{n_1} \sum_{j_2=1}^{n_2} \cdots \sum_{j_d=1}^{n_d} \sum_{j_{d+1}=1}^{n_{d+1}} a_{1,j_1} a_{2,j_2} \cdots a_{d+1,j_{d+1}}. \end{aligned}$$

所以(1.1.2) 成立. \square

§1.2. \mathbb{R}^d 中开集的结构

【 \mathbb{R}^d 中的区间】 回忆: \mathbb{R}^d 中的 d 维有界区间 I 是 d 个一维有界区间的乘积, 即

$$I = [a_1, b_1] \times [a_2, b_2] \times \cdots \times [a_d, b_d] = \prod_{i=1}^d [a_i, b_i] \quad (\text{有界闭区间}),$$

$$I = (a_1, b_1) \times (a_2, b_2) \times \cdots \times (a_d, b_d) = \prod_{i=1}^d (a_i, b_i) \quad (\text{有界开区间}),$$

$$I = [a_1, b_1) \times [a_2, b_2) \times \cdots \times [a_d, b_d) = \prod_{i=1}^d [a_i, b_i) \quad (\text{左闭右开的有界区间})$$

$$I = (a_1, b_1] \times (a_2, b_2] \times \cdots \times (a_d, b_d] = \prod_{i=1}^d (a_i, b_i] \quad (\text{左开右闭的有界区间})$$

等等. 每个一维区间 $[a_i, b_i], (a_i, b_i), [a_i, b_i), (a_i, b_i]$ 称为区间 I 的边或棱. 由 I 的边的左、右端点构成的向量 $(a_1, a_2, \dots, a_d), (b_1, b_2, \dots, b_d)$ 称为区间 I 的左、右端点.

定义 I 的面积或体积为 I 的各棱长的乘积, 即 (无论各条棱是否为闭区间)

$$|I| = |I^\circ| = |\bar{I}| = (b_1 - a_1)(b_2 - a_2) \cdots (b_d - a_d) = \prod_{i=1}^d (b_i - a_i).$$

注意: \mathbb{R}^d 中的区间要求是非退化的, 即 I 的各棱长必须大于零! 因此总有 $|I| > 0$.

□

• **区间的内部, 闭包和边界.** 设 $d(\geq 2)$ 维有界区间 I 的左、右端点为 $(a_1, a_2, \dots, a_d), (b_1, b_2, \dots, b_d)$. 则易见

$$I^\circ = \prod_{i=1}^d (a_i, b_i), \quad \bar{I} = \prod_{i=1}^d [a_i, b_i]$$

因此 I 的边界为

$$\partial I = \bar{I} \setminus I^\circ = \bigcup_{k=1}^d \left(\prod_{i=1}^d [a_i, b_i] \right) \Big|_{\text{其中 } [a_k, b_k] \text{ 被换成二元素集 } \{a_k, b_k\}}. \quad (1.2.1)$$

它说明边界 ∂I 是由 $2d$ 个 $d-1$ 维有界闭区间组成的. 建议用 $d=2, 3$ 的情形 (即平面矩形和三维长方体) 检验一下.

• **区间的直径.** 不难看出 d 维有界区间 I 的直径等于 I 的左、右端点 $\mathbf{a} = (a_1, a_2, \dots, a_d), \mathbf{b} = (b_1, b_2, \dots, b_d)$ 的距离, 也即等于 I 的对角线之长:

$$\text{diam}(I) = \text{diam}(I^\circ) = \text{diam}(\bar{I}) = \left(\sum_{i=1}^d (b_i - a_i)^2 \right)^{1/2} = |\mathbf{b} - \mathbf{a}|.$$

由此得到常用的估计式

$$\text{diam}(I) \leq \sqrt{d} \max_{1 \leq i \leq d} (b_i - a_i).$$

• **区间的分划.** 设 I 是以 $(a_1, a_2, \dots, a_d), (b_1, b_2, \dots, b_d)$ 为左、右端点的有界区间. 给定任意 $\delta > 0$ 我们对每个一维区间 $[a_i, b_i]$ 做分划:

$$a_i = a_{i,0} < a_{i,1} < a_{i,2} < \dots < a_{i,n_i} = b_i \quad \text{满足} \quad a_{i,j} - a_{i,j-1} < \frac{\delta}{\sqrt{d}}, \quad j = 1, 2, \dots, n_i.$$

则有

$$[a_i, b_i] = \bigcup_{j=1}^{n_i} [a_{i,j-1}, a_{i,j}], \quad [a_i, b_i) = \bigcup_{j=1}^{n_i} [a_{i,j-1}, a_{i,j}), \quad \text{etc.}$$

从而由并集的乘积公式得到 I 的一个分划:

$$I = \bigcup_{j_1=1}^{n_1} \bigcup_{j_2=1}^{n_2} \dots \bigcup_{j_d=1}^{n_d} I_{j_1, j_2, \dots, j_d} \quad (1.2.2)$$

其中

$$I_{j_1, j_2, \dots, j_d} = \prod_{i=1}^d [a_{i, j_i-1}, a_{i, j_i}] \quad \text{或} \quad = \prod_{i=1}^d [a_{i, j_i-1}, a_{i, j_i}) \quad \text{etc.}$$

同时由数值和的乘积公式(1.1.2) 得到

$$|I| = \prod_{i=1}^d (b_i - a_i) = \prod_{i=1}^d \left(\sum_{j=1}^{n_i} (a_{i,j} - a_{i,j-1}) \right) = \sum_{j_1=1}^{n_1} \sum_{j_2=1}^{n_2} \dots \sum_{j_d=1}^{n_d} \prod_{i=1}^d (a_{i, j_i} - a_{i, j_i-1})$$

即

$$|I| = \sum_{j_1=1}^{n_1} \sum_{j_2=1}^{n_2} \dots \sum_{j_d=1}^{n_d} |I_{j_1, j_2, \dots, j_d}|. \quad (1.2.3)$$

由于 I_{j_1, j_2, \dots, j_d} 的每条棱的长度 $< \delta/\sqrt{d}$, 故有

$$\text{diam}(I_{j_1, j_2, \dots, j_d}) < \sqrt{d} \frac{\delta}{\sqrt{d}} = \delta.$$

这表明 I 可以被分解成有限多个直径 $< \delta$ 的区间的并.

此外易见当 I 左闭右开时, 相应的子区间 I_{j_1, j_2, \dots, j_d} (左闭右开) 是互不相交的. 对于一般情形, 诸子区间 I_{j_1, j_2, \dots, j_d} 的内部总是互不相交的, 也即 I_{j_1, j_2, \dots, j_d} 是互不重叠的.

• **区间的平移、展缩、反射还是区间.**

设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为任一集合. 对任意 $h \in \mathbb{R}^d, \lambda > 0$, 我们定义

$$E + h = h + E = \{x + h \mid x \in E\} \quad (E \text{ 的平移}),$$

$$\lambda E = \{\lambda x \mid x \in E\} \quad (E \text{ 的展缩}),$$

$$-E = (-1)E = \{-x \mid x \in E\} \quad (E \text{ 的反射}).$$

一般地定义

$$\lambda E + h = \{\lambda x + h \mid x \in E\}, \quad h \in \mathbb{R}^d, \lambda \in \mathbb{R}. \quad (1.2.4)$$

现在设 $E = I$ 是一个 d 维有界区间. 例如设 $I = \prod_{i=1}^d [a_i, b_i)$ 是左闭右开的. 则对任意 $h = (h_1, h_2, \dots, h_d) \in \mathbb{R}^d$ 和任意 $\lambda \in \mathbb{R} \setminus \{0\}$ 有

$$\lambda I + h = \prod_{i=1}^d [\lambda a_i + h_i, \lambda b_i + h_i) \quad \text{if } \lambda > 0,$$

$$\lambda I + h = \prod_{i=1}^d (\lambda b_i + h_i, \lambda a_i + h_i] \quad \text{if } \lambda < 0.$$

这表明 d 维有界区间的平移、展缩、反射还是 d 维有界区间.

• \mathbb{R}^d 中开集的结构

为了定义和计算一个集合的测度(长度、面积、体积等等), 我们需要知道最基本的集合——开集——的结构。

当 $d = 1$ 时, 由于 \mathbb{R} 是有序集, 我们在数学分析中已证明了 \mathbb{R} 中的开集可以被唯一地表示成可数个互不相交的开区间的并, 即

$$\text{若 } \mathcal{O} \subset \mathbb{R} \text{ 是开集, 则 } \mathcal{O} = \bigcup_{k \geq 1} (a_k, b_k), \quad \text{其中 } (a_k, b_k) \text{ 是互不相交的开区间.}$$

因此这开集的长度可以被定义为等于这些开区间的长度之和(对于无界的开区间, 定义其长度为 $+\infty$)。

当 $d \geq 2$ 时, 由于 \mathbb{R}^d 是无序集, 向量的方向有无限多个, 因此关于 \mathbb{R}^d 中的开集的表示就没有统一结果。但是我们将证明 \mathbb{R}^d 中的开集可以被表示成可数无限多个左闭右开的正方形或方体的并, 而且可以要求这些正方形或方体是 2-进正方形或 2-进方体。于是开集的面积(或体积)就等于这些正方形(或方体)的面积(体积)之和。而对 \mathbb{R}^d 中其他类型的集合, 可以用开集逼近之, 其面积(或体积)也就定义为这些开集的面积(或体积)的极限。由此可见弄清开集的结构是件很基本的事情。

• 2-进方体. 形如

$$\prod_{i=1}^d \left[\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i + 1}{2^k} \right], \quad \prod_{i=1}^d \left(\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i + 1}{2^k} \right), \quad \prod_{i=1}^d \left[\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i + 1}{2^k} \right), \quad \prod_{i=1}^d \left(\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i + 1}{2^k} \right]$$

(其中 $k, p_i \in \mathbb{Z}$) 的 d 维 2-进区间分别称为 2-进闭方体, 2-进开方体, 左闭右开的 2-进方体和左开右闭的 2-进方体。统称它们为 2-进方体。如用 Q 表示任意 2-进方体, 用 $l(Q)$ 表示 Q 的边长, 则易见

$$l(Q) = 2^{-k}, \quad |Q| = [l(Q)]^d, \quad \text{diam}(Q) = \sqrt{d}l(Q).$$

当 $k = 0, p_i = 0 (i = 1, 2, \dots, n)$ 时, Q 即为单位方体, 即 $Q = [0, 1]^d, (0, 1)^d, [0, 1)^d, (0, 1]^d$.

如上, 不难看出 \mathbb{R}^d 中只有可数无限多个 2-进方体。事实上, 以左闭右开的 2-进方体为例, 令 \mathcal{Q}^d 表示 \mathbb{R}^d 中的左闭右开的 2-进方体的全体, 则对应关系

$$(k, p_1, p_2, \dots, p_d) \mapsto Q = \prod_{i=1}^d \left[\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i + 1}{2^k} \right)$$

给出 \mathbb{Z}^{d+1} 到 \mathcal{Q}^d 到的 1-1 对应。因为 \mathbb{Z}^{d+1} 是可数集, 所以 \mathcal{Q}^d 是可数集。

【命题 1.2.1(2-进方体的特性).】 设 $d \in \mathbb{N}$, Q_1, Q_2 为 \mathbb{R}^d 中任意两个左闭右开的 2-进方体。则只有下列三种情形之一出现:

$$\text{或者 } Q_1 \cap Q_2 = \emptyset \quad \text{或者 } Q_1 \subset Q_2 \quad \text{或者 } Q_2 \subset Q_1.$$

进一步, 假设 $Q_1 \cap Q_2 \neq \emptyset$, 则有以下关系:

$$l(Q_1) \leq l(Q_2) \iff Q_1 \subset Q_2 \iff \overline{Q_1} \subset \overline{Q_2}, \quad (1.2.5)$$

$$l(Q_1) = l(Q_2) \iff Q_1 = Q_2 \iff \overline{Q_1} = \overline{Q_2}. \quad (1.2.6)$$

特别可知, 若 $l(Q_1) = l(Q_2)$, 则有: $Q_1 \neq Q_2 \iff Q_1 \cap Q_2 = \emptyset$.

【证】 写

$$Q_1 = \prod_{i=1}^d \left[\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i + 1}{2^k} \right), \quad Q_2 = \prod_{i=1}^d \left[\frac{q_i}{2^m}, \frac{q_i + 1}{2^m} \right).$$

假设 $Q_1 \cap Q_2 \neq \emptyset$ 且 $l(Q_1) \leq l(Q_2)$. 取一点 $c = (c_1, c_2, \dots, c_d) \in Q_1 \cap Q_2$, 则有

$$\frac{p_i}{2^k} \leq c_i < \frac{p_i + 1}{2^k}, \quad \frac{q_i}{2^m} \leq c_i < \frac{q_i + 1}{2^m}, \quad i = 1, 2, \dots, d.$$

借助公共数 c_i 传递不等式, 得到

$$\frac{p_i}{2^k} < \frac{q_i + 1}{2^m}, \quad \frac{q_i}{2^m} < \frac{p_i + 1}{2^k}, \quad i = 1, 2, \dots, d$$

即

$$p_i < 2^{k-m}(q_i + 1), \quad 2^{k-m}q_i < p_i + 1, \quad i = 1, 2, \dots, d.$$

因 $l(Q_1) \leq l(Q_2)$ 即 $2^{-k} \leq 2^{-m}$ 也即 $k \geq m$, 故 2^{k-m} , p_i , q_i 皆为整数. 因此

$$p_i + 1 \leq 2^{k-m}(q_i + 1), \quad 2^{k-m}q_i \leq p_i, \quad i = 1, 2, \dots, d$$

即

$$\frac{q_i}{2^m} \leq \frac{p_i}{2^k} < \frac{p_i + 1}{2^k} \leq \frac{q_i + 1}{2^m}, \quad j = 1, 2, \dots, d. \quad (1.2.7)$$

因此 $Q_1 \subset Q_2$ 从而 $\overline{Q_1} \subset \overline{Q_2}$.

反之假设 $\overline{Q_1} \subset \overline{Q_2}$ 即

$$\prod_{i=1}^d \left[\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i + 1}{2^k} \right] \subset \prod_{i=1}^d \left[\frac{q_i}{2^m}, \frac{q_i + 1}{2^m} \right]$$

则由乘积集合的包含关系有

$$\left[\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i + 1}{2^k} \right] \subset \left[\frac{q_i}{2^m}, \frac{q_i + 1}{2^m} \right], \quad i = 1, 2, \dots, d$$

这蕴含(1.2.7) 成立. 于是有 $Q_1 \subset Q_2$. 这就证明了(1.2.5). 由(1.2.5) 即得(1.2.6). \square

根据实数的阿基米德原理知对任意 $k \in \mathbb{Z}$, 实数轴 \mathbb{R} 可以被分解成互不相交的左闭右开的2-进区间 $[\frac{p}{2^k}, \frac{p+1}{2^k})$ 的并:

$$\mathbb{R} = \bigcup_{p \in \mathbb{Z}} \left[\frac{p}{2^k}, \frac{p+1}{2^k} \right) = \bigcup_{p \in \mathbb{Z}} \left[\frac{p}{2^k}, \frac{p+1}{2^k} \right].$$

因 $\mathbb{R}^d = \mathbb{R} \times \mathbb{R} \times \dots \times \mathbb{R}$ (d 个)是 \mathbb{R} 的 d 次笛卡尔积, 故得到 \mathbb{R}^d 的2进方体分解:

$$\mathbb{R}^d = \bigcup_{(p_1, p_2, \dots, p_d) \in \mathbb{Z}^d} \prod_{i=1}^d \left[\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i + 1}{2^k} \right) = \bigcup_{(p_1, p_2, \dots, p_d) \in \mathbb{Z}^d} \prod_{i=1}^d \left[\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i + 1}{2^k} \right]. \quad (1.2.8)$$

由此易见, 对于 \mathbb{R}^d 中的任意点 x 的任意邻域 $U(x)$, 只要 $k \in \mathbb{N}$ 充分大, 就存在一个2 进闭方体 $\prod_{i=1}^d [\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i+1}{2^k}] \subset U(x)$ 使得 $x \in \prod_{i=1}^d [\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i+1}{2^k}]$. 根据这一性质容易相信, \mathbb{R}^d 中任一非空开集 Ω 可以被分解成可数个互不相交的左闭右开的2-进方体的并, 而且可以要求这些方体的闭包也含于 Ω 中. 详细来说我们有下列定理:

【定理1.2.2(开集的方体分解)】 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为任一非空开集, M 为一整数. 则存在一系列互不相交的 左闭右开的2-进方体 $\{Q_k\}_{k=1}^\infty$ 满足边长 $l(Q_k) \leq 2^{-M}$, 使得

$$\Omega = \bigcup_{k=1}^\infty Q_k = \bigcup_{k=1}^\infty \overline{Q_k}. \quad (1.2.9)$$

(对 $d = 2$ 的情形给出图示和解释.)

【证】令 $\mathcal{Q}^{(k)}$ 表示棱长等于 2^{-k} 的所有左闭右开2-进方体的集合, 即

$$\mathcal{Q}^{(k)} = \left\{ \prod_{i=1}^d \left[\frac{p_i}{2^k}, \frac{p_i+1}{2^k} \right) \mid p_i \in \mathbb{Z}, i = 1, 2, \dots, d \right\}.$$

我们把所有其闭包含于 Ω 内的满足棱长 $\leq 2^{-M}$ 的最大的左闭右开的2-进方体做成一个集合 \mathcal{C} , 即

$$\mathcal{C} = \left\{ Q^* \in \bigcup_{k \geq M} \mathcal{Q}^{(k)} \mid \overline{Q^*} \subset \Omega \text{ 且满足: 若 } Q \in \bigcup_{k \geq M} \mathcal{Q}^{(k)} \text{ 且 } Q^* \subset \overline{Q} \subset \Omega, \text{ 则 } Q^* = Q \right\}.$$

来证明

$$\mathcal{C} \text{ 中不同的元素不相交, 即若 } Q_1^*, Q_2^* \in \mathcal{C} \text{ 且 } Q_1^* \neq Q_2^*, \text{ 则 } Q_1^* \cap Q_2^* = \emptyset. \quad (1.2.10)$$

$$\Omega = \bigcup_{Q^* \in \mathcal{C}} Q^* = \bigcup_{Q^* \in \mathcal{C}} \overline{Q^*}. \quad (1.2.11)$$

(1.2.10) 的证明: 设 $Q_1^*, Q_2^* \in \mathcal{C}$ 且 $Q_1^* \neq Q_2^*$. 假如 $Q_1^* \cap Q_2^* \neq \emptyset$, 则由**命题1.2.1(2-进方体的特性)**知二者有包含关系: 例如 $Q_1^* \subset Q_2^*$, 从而有 $Q_1^* \subset \overline{Q_2^*} \subset \Omega$. 而由 \mathcal{C} 的定义知这蕴含 $Q_1^* = Q_2^*$, 矛盾于 $Q_1^* \neq Q_2^*$. 因此必有 $Q_1^* \cap Q_2^* = \emptyset$. 这证明了(1.2.10) 成立.

(1.2.11) 的证明: 显然有 $\bigcup_{Q^* \in \mathcal{C}} Q^* \subset \bigcup_{Q^* \in \mathcal{C}} \overline{Q^*} \subset \Omega$. 为证(1.2.11), 只需证明 $\Omega \subset \bigcup_{Q^* \in \mathcal{C}} Q^*$. 任取一点 $x = (x_1, x_2, \dots, x_d) \in \Omega$. 因 Ω 是开集, 故存在 $\delta > 0$ 使得 $B(x, \delta) \subset \Omega$. 选取 $k_0 \in \mathbb{Z}$ 充分大, 使得 $k_0 \geq M$ 且 $\sqrt{d} 2^{-k_0} < \delta$. 令 $p_i = [2^{k_0} x_i]$ ($= 2^{k_0} x_i$ 的整数部分). 则有

$$p_i \leq 2^{k_0} x_i < p_i + 1 \quad \text{即} \quad \frac{p_i}{2^{k_0}} \leq x_i < \frac{p_i + 1}{2^{k_0}}, \quad i = 1, 2, \dots, d.$$

因此

$$x = (x_1, x_2, \dots, x_d) \in Q_0 := \prod_{i=1}^d \left[\frac{p_i}{2^{k_0}}, \frac{p_i+1}{2^{k_0}} \right), \quad Q_0 \in \mathcal{Q}^{(k_0)}.$$

因 $\forall y \in \overline{Q_0} \implies |y - x| \leq \text{diam}(\overline{Q_0}) = \sqrt{d} 2^{-k_0} < \delta \implies y \in B(x, \delta)$, 故 $\overline{Q_0} \subset B(x, \delta) \subset \Omega$. 现在我们考虑整数子集

$$\mathbb{Z}_0 = \{k \in \mathbb{Z} \mid k \geq M \text{ 且存在 } Q \in \mathcal{Q}^{(k)} \text{ 使得 } Q_0 \subset \overline{Q} \subset \Omega\}.$$

由 $k_0 \geq M$ 和 $\overline{Q_0} \subset \Omega$ 可知 $k_0 \in \mathbb{Z}_0$, 因此 $\mathbb{Z}_0 \neq \emptyset$. 又因 \mathbb{Z}_0 有下界 M , 故 \mathbb{Z}_0 的最小数 $m = \min \mathbb{Z}_0$ 存在且 $m \geq M$. 于是存在 $Q^* \in \mathcal{Q}^{(m)}$ 使得 $Q_0 \subset \overline{Q^*} \subset \Omega$. 由于 Q_0, Q^* 都是左闭右开的2-进方体, 故 $Q_0 \subset Q^*$. 我们断言 $Q^* \in \mathcal{C}$. 事实上首先我们

有 $Q^* \in \bigcup_{k \geq M} \mathcal{Q}^{(k)}$ 且 $\overline{Q^*} \subset \Omega$. 其次任取 $Q \in \bigcup_{k \geq M} \mathcal{Q}^{(k)}$ 满足 $Q^* \subset \overline{Q} \subset \Omega$. 我们来证明 $Q^* = Q$. 由 $Q \in \bigcup_{k \geq M} \mathcal{Q}^{(k)}$ 知存在 $k \geq M$ 使得 $Q \in \mathcal{Q}^{(k)}$. 根据 \mathbb{Z}_0 的定义易见 $k \in \mathbb{Z}_0$. 因此 $m \leq k$. 另一方面, 由 **命题1.2.1(2-进方体的特性)** 知 $Q^* \subset \overline{Q}$ 蕴涵 $Q^* \subset Q$ 从而有 $l(Q^*) \leq l(Q)$, 即 $2^{-m} \leq 2^{-k}$. 所以 $m \geq k$ 从而 $m = k$. 因此 $l(Q^*) = l(Q)$. 再由 **命题1.2.1(2-进方体的特性)** 即得 $Q^* = Q$. 据 \mathcal{C} 的定义, 这就证明了 $Q^* \in \mathcal{C}$. 于是由 $x \in Q_0 \subset Q^*$ 和 $Q^* \in \mathcal{C}$ 即知 $x \in \bigcup_{Q^* \in \mathcal{C}} Q^*$. 所以 $\Omega \subset \bigcup_{Q^* \in \mathcal{C}} Q^*$. 所以(1.2.11)成立.

最后证明 \mathcal{C} 是可数无限集. 因 \mathbb{R}^d 中只有可数无限多个2-进方体, 故 \mathcal{C} 是可数集. 假设 \mathcal{C} 是有限集:

$$\mathcal{C} = \left\{ \prod_{i=1}^d [a_{i,k}, b_{i,k}) \mid k = 1, 2, \dots, N \right\}, \quad N \in \mathbb{N}.$$

考虑 \mathcal{C} 中诸方体各条棱的最小左端点(它的存在性由“有限”保证):

$$a_{k_0}^{i_0} = \min\{a_{i,k} \mid 1 \leq i \leq n, 1 \leq k \leq N\}.$$

对于这个 k_0 我们有

$$x_0 := (a_{1,k_0}, a_{2,k_0}, \dots, a_{d,k_0}) \in \prod_{i=1}^d [a_{i,k_0}, b_{i,k_0}) \subset \Omega$$

因此存在 $\delta > 0$ 使得 $B(x_0, \delta) \subset \Omega$. 如取 ε 满足 $0 < \varepsilon < \delta/\sqrt{d}$, 则有

$$(a_{1,k_0} - \varepsilon, a_{2,k_0} - \varepsilon, \dots, a_{d,k_0} - \varepsilon) \in B(x_0, \delta) \subset \Omega = \bigcup_{k=1}^N \prod_{i=1}^d [a_{i,k}^i, b_{i,k}^i).$$

于是对某个 $k_1 \in \{1, 2, \dots, N\}$ 有 $(a_{1,k_0} - \varepsilon, a_{2,k_0} - \varepsilon, \dots, a_{d,k_0} - \varepsilon) \in \prod_{i=1}^d [a_{i,k_1}, b_{i,k_1})$ 从而有 $a_{i_0,k_0} - \varepsilon \in [a_{i_0,k_1}, b_{i_0,k_1})$ 这导致 $a_{i_0,k_1} \leq a_{i_0,k_0} - \varepsilon < a_{i_0,k_0}$, 它与 a_{i_0,k_0} 的最小性矛盾. 因此 \mathcal{C} 必是可数无限集. 将 \mathcal{C} 表为 $\mathcal{C} = \{Q_k\}_{k=1}^\infty$ 并代入(1.2.11) 即得(1.2.9) 并由(1.2.10) 知 Q_k 互不相交. 命题证毕. \square

最后说明: 本讲义将用 $\text{dist}(x, y) = |x - y|$ 表示欧空间 $(\mathbb{R}^d, |\cdot|)$ 上的距离函数, 因此对任意 $x \in \mathbb{R}^d$ 和 $A, B \subset \mathbb{R}^d$ 有

$$\text{dist}(x, A) = \inf_{y \in A} |x - y|, \quad \text{dist}(A, B) = \inf_{x \in A, y \in B} |x - y|.$$

其中对于空集 \emptyset 的情形, 定义 $\text{dist}(x, \emptyset) = +\infty, \text{dist}(A, \emptyset) = \text{dist}(\emptyset, B) = +\infty$.

【注】 把上述**命题1.2.1(2-进方体的特性)** 和**定理1.2.2(开集的方体分解)** 中的“左闭右开”换成“左开右闭”, 照搬相同的论证可知结论照样成立.

• 看特征函数的一个典型应用——

【命题1.2.3(区间的估计)】 设 I, I_k 为 \mathbb{R}^d 中的有界区间, $k = 1, 2, \dots, n$. 则有蕴含关系:

$$\text{若 } I \subset \bigcup_{k=1}^n I_k \text{ 则 } |I| \leq \sum_{k=1}^n |I_k|.$$

$$\text{若 } I_k \text{ 互不重叠且 } \bigcup_{k=1}^n I_k \subset I \text{ 则 } \sum_{k=1}^n |I_k| \leq |I|.$$

$$\text{特别, 若 } I_k \text{ 互不重叠且 } I = \bigcup_{k=1}^n I_k \text{ 则 } |I| = \sum_{k=1}^n |I_k|.$$

【证】 我们将利用集合的特征函数和一元黎曼积分的基本性质. 我们先看 $d = 1$ (一维)的情形. 取实数 $\alpha < \beta \in \mathbb{R}$ 使得 $I, I_k \subset [\alpha, \beta], k = 1, 2, \dots, n$. 不妨设 I, I_k 都是闭区间:

$$I = [a, b], \quad I_k = [a_k, b_k].$$

假设 $[a, b] \subset \bigcup_{k=1}^n [a_k, b_k]$. 来证明

$$b - a \leq \sum_{k=1}^n (b_k - a_k).$$

由特征函数的性质易见

$$\mathbf{1}_{[a,b]}(x) \leq \sum_{k=1}^n \mathbf{1}_{[a_k,b_k]}(x), \quad x \in [\alpha, \beta].$$

易见这些特征函数都在 $[\alpha, \beta]$ 上黎曼可积(每个只有两个间断点). 因此对上述不等式两边取黎曼积分即得(根据积分的单调性、线性性等)

$$b - a = \int_{\alpha}^{\beta} \mathbf{1}_{[a,b]}(x) dx \leq \int_{\alpha}^{\beta} \sum_{k=1}^n \mathbf{1}_{[a_k,b_k]}(x) dx = \sum_{k=1}^n \int_{\alpha}^{\beta} \mathbf{1}_{[a_k,b_k]}(x) dx = \sum_{k=1}^n (b_k - a_k).$$

对于第二个不等式, 假设 $[a_k, b_k]$ 互不重叠且 $\bigcup_{k=1}^n [a_k, b_k] \subset [a, b]$. 来证明

$$\sum_{k=1}^n (b_k - a_k) \leq b - a.$$

事实上由 (a_k, b_k) 互不相交且 $\bigcup_{k=1}^n (a_k, b_k) \subset [a, b]$, 有

$$\sum_{k=1}^n \mathbf{1}_{(a_k,b_k)}(x) \leq \mathbf{1}_{[a,b]}(x), \quad x \in [\alpha, \beta].$$

两边去积分即得

$$\sum_{k=1}^n (b_k - a_k) = \sum_{k=1}^n \int_{\alpha}^{\beta} \mathbf{1}_{(a_k,b_k)}(x) dx = \int_{\alpha}^{\beta} \sum_{k=1}^n \mathbf{1}_{(a_k,b_k)}(x) dx \leq \int_{\alpha}^{\beta} \mathbf{1}_{[a,b]}(x) dx = b - a.$$

下面证明一般情形(维数 $d \geq 1$). 取 $0 < R < \infty$ 充分大使得

$$I, I_k \subset [-R, R]^d, \quad k = 1, 2, \dots, d.$$

由 d 维区间的定义可写

$$I = J_1 \times J_2 \times \cdots \times J_d, \quad I_k = J_{1,k} \times J_{2,k} \times \cdots \times J_{d,k}$$

其中 $I_i, J_{i,k}$ 分别是含于 $[-R, R]$ 中的闭区间和开区间($i = 1, 2, \dots, d$).

假设 $I \subset \bigcup_{k=1}^n I_k$. 则由特征函数的性质有

$$\mathbf{1}_I(x) \leq \sum_{k=1}^n \mathbf{1}_{I_k}(x), \quad x \in [-R, R]^d.$$

而由乘积集合的特征函数等于特征函数的乘积 知

$$\mathbf{1}_I(x) = \mathbf{1}_{J_1}(x_1)\mathbf{1}_{J_2}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_d}(x_d), \quad \mathbf{1}_{I_k}(x) = \mathbf{1}_{J_{1,k}}(x_1)\mathbf{1}_{J_{2,k}}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_{d,k}}(x_d)$$

其中 $x = (x_1, x_2, \dots, x_d) \in [-R, R]^d$, 因此上面不等式可写成

$$\mathbf{1}_{J_1}(x_1)\mathbf{1}_{J_2}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_d}(x_d) \leq \sum_{k=1}^n \mathbf{1}_{J_{1,k}}(x_1)\mathbf{1}_{J_{2,k}}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_{d,k}}(x_d). \quad (1.2.12)$$

固定任意 $(x_2, x_3, \dots, x_d) \in [-R, R]^{d-1}$, 不等式(1.2.12) 两边都是变量 $x_1 \in [-R, R]$ 的Riemann 可积函数(因为 \mathbb{R} 中有界区间的特征函数在 \mathbb{R} 中任何有界闭区间上都是Riemann 可积的), 因此对不等式(1.2.12) 两边关于 x_1 在 $[-R, R]$ 上取Riemann 积分并注意

$$|I_1| = \int_{-R}^R \mathbf{1}_{J_1}(x_1) dx_1, \quad |J_{1,k}| = \int_{-R}^R \mathbf{1}_{J_{1,k}}(x_1) dx_1$$

得到

$$\begin{aligned} |J_1| \mathbf{1}_{J_2}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_d}(x_d) &= \int_{-R}^R \mathbf{1}_{J_1}(x_1) dx_1 \mathbf{1}_{J_2}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_d}(x_d) \\ &= \int_{-R}^R \mathbf{1}_{J_1}(x_1) \mathbf{1}_{J_2}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_d}(x_d) dx_1 \leq \int_{-R}^R \sum_{k=1}^n \mathbf{1}_{J_{1,k}}(x_1) \mathbf{1}_{J_{2,k}}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_{d,k}}(x_d) dx_1 \\ &= \sum_{k=1}^n \left(\int_{-R}^R \mathbf{1}_{J_{1,k}}(x_1) dx_1 \right) \mathbf{1}_{J_{2,k}}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_{d,k}}(x_d) = \sum_{k=1}^n |J_{1,k}| \mathbf{1}_{J_{2,k}}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_{d,k}}(x_d). \end{aligned} \quad (1.2.13)$$

同理固定任意 $(x_3, \dots, x_d) \in [-R, R]^{d-2}$, 对不等式(1.2.13)两边关于 x_2 在 $[-R, R]$ 上取积分得到

$$|J_1| |J_2| \mathbf{1}_{J_3}(x_3) \cdots \mathbf{1}_{J_d}(x_d) \leq \sum_{k=1}^d |J_{1,k}| |J_{2,k}| \mathbf{1}_{J_{3,k}}(x_3) \cdots \mathbf{1}_{J_{d,k}}(x_d).$$

如此操作下去(用归纳法原理), 在第 d 步得到

$$|J_1||J_2|\cdots|J_d| \leq \sum_{k=1}^n |J_{1,k}||J_{2,k}|\cdots|J_{d,k}| \quad \text{即} \quad |I| \leq \sum_{k=1}^n |I_k|.$$

所以命题中的第一个不等式成立.

最后设 I_k 互不重叠且 $\bigcup_{k=1}^n I_k \subset I$. 则 I_k° 互不相交且 $\bigcup_{k=1}^n I_k^\circ \subset I$ 从而有

$$\sum_{k=1}^n \mathbf{1}_{I_k^\circ}(x) \leq \mathbf{1}_I(x), \quad x \in [-R, R]^d.$$

注意

$$I_k^\circ = J_{1,k}^\circ \times J_{2,k}^\circ \times \cdots \times J_{d,k}^\circ$$

因此

$$\sum_{k=1}^n \mathbf{1}_{J_{1,k}^\circ}(x_1) \mathbf{1}_{J_{2,k}^\circ}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_{d,k}^\circ}(x_d) \leq \mathbf{1}_{J_1}(x_1) \mathbf{1}_{J_1}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_d}(x_d)$$

$x = (x_1, x_2, \dots, x_d) \in [-R, R]^d$. 两边对 $x_1 \in [-R, R]$ 取积分有

$$\begin{aligned} \sum_{k=1}^n |J_{1,k}^\circ| \mathbf{1}_{J_{2,k}^\circ}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_{d,k}^\circ}(x_d) &= \sum_{k=1}^n \int_{-R}^R \mathbf{1}_{J_{1,k}^\circ}(x_1) dx_1 \mathbf{1}_{J_{2,k}^\circ}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_{d,k}^\circ}(x_d) \\ &\leq \int_{-R}^R \mathbf{1}_{J_1}(x_1) dx_1 \mathbf{1}_{J_1}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_d}(x_d) = |J_1| \mathbf{1}_{J_2}(x_2) \cdots \mathbf{1}_{J_d}(x_d). \end{aligned}$$

再对 $x_2 \in [-R, R]$ 取积分得到

$$\sum_{k=1}^n |J_{1,k}^\circ| |J_{2,k}^\circ| \mathbf{1}_{J_{3,k}^\circ}(x_3) \cdots \mathbf{1}_{J_{d,k}^\circ}(x_d) \leq |J_1| |J_2| \mathbf{1}_{J_3}(x_3) \cdots \mathbf{1}_{J_d}(x_d).$$

据归纳法得到

$$\sum_{k=1}^n |J_{1,k}^\circ| |J_{2,k}^\circ| \cdots |J_{d,k}^\circ| \leq |J_1| |J_2| \cdots |J_d|.$$

最后注意

$$|J_{1,k}^\circ| |J_{2,k}^\circ| \cdots |J_{d,k}^\circ| = |J_{1,k}| |J_{2,k}| \cdots |J_{d,k}| = |J_{1,k} \times J_{2,k} \times \cdots \times J_{d,k}| = |I_k|$$

即完成了证明. \square

【注】我在课上只给出 $d = 1, 2$ 的证明, 一般情形的证明留为作业。

作业题(2018.3.2)

1. 周民强《实变函数论》(2001年版, 北大出版社)P8: 1,2,3 (集合习题), P12: 1,2 (集合与函数), P16: 6,7 (集合与映射), P65: 8 (关于可数集) 【注: 原来留的第6题是错的(感谢汪圣同学指出错误), 现改为该页第8题。】, P66:18 (关于紧集), P68: 29 (关于覆盖).
2. Stein 和Shakarchi 的实分析第一章第12 题(可以考虑闭包...).
3. 完成课上给出的命题(区间估计)的证明。

周民强的书因各版页码可能不同, 故将上面留的题目抄录如下:

周P8: 1,2,3 (集合习题) 证明下列命题:

1. 设 A, B, E 是全集 X 的子集, 则

$$B = (E \cap A)^c \cap (E^c \cup A) \iff B^c = E.$$

2. 设 $A_1 \subset A_2 \subset \cdots \subset A_n \subset \cdots, B_1 \subset B_2 \subset \cdots \subset B_n \subset \cdots$, 则

$$\left(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n\right) \cap \left(\bigcup_{n=1}^{\infty} B_n\right) = \bigcup_{n=1}^{\infty} A_n \cap B_n.$$

3. 设 $A_1 \supset A_2 \supset \cdots \supset A_n \supset \cdots, B_1 \supset B_2 \supset \cdots \supset B_n \supset \cdots$, 则

$$\left(\bigcap_{n=1}^{\infty} A_n\right) \cup \left(\bigcap_{n=1}^{\infty} B_n\right) = \bigcap_{n=1}^{\infty} (A_n \cup B_n).$$

周P12: 1,2 (集合与函数) 试证明下列命题:

1. 设

$$A_n = \left\{ \frac{m}{n} \mid m \in \mathbb{Z} \right\}, \quad B_n = \left(\frac{1}{n}, 1 + \frac{1}{n} \right), \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

则

$$\bigcap_{k=1}^{\infty} \bigcup_{n=k}^{\infty} A_n = \mathbb{Q}, \quad \bigcup_{k=1}^{\infty} \bigcap_{n=k}^{\infty} A_n = \mathbb{Z}, \quad \bigcap_{k=1}^{\infty} \bigcup_{n=k}^{\infty} B_n = \bigcup_{k=1}^{\infty} \bigcap_{n=k}^{\infty} B_n = (0, 1].$$

2. 设 $f_n(x), f(x)$ 都是定义在 \mathbb{R} 上的实值函数且有

$$\lim_{n \rightarrow \infty} f_n(x) = f(x), \quad x \in \mathbb{R}.$$

则对任意 $t \in \mathbb{R}$ 有

$$\{x \in \mathbb{R} \mid f(x) \leq t\} = \bigcap_{k=1}^{\infty} \bigcup_{m=1}^{\infty} \bigcap_{n=m}^{\infty} \left\{ x \in \mathbb{R} \mid f_n(x) < t + \frac{1}{k} \right\}.$$

周P16: 6,7 (集合与映射) 试证明下列命题:

6. 设 E 是由10个两位数字的数形成的集合, 则 E 中必有两个不相交的子集, 其元素个数相同. (此题可能抄错了.)

7. 设 $f: X \rightarrow Y, g: Y \rightarrow X$ 满足

$$g(f(x)) = x \quad \forall x \in X.$$

则 f 是单射, g 是满射.

周P65: 8 (关于可数集)

8. 设 $f(x)$ 是 \mathbb{R} 上的实值函数。假设 \mathbb{R} 中每一点都是 f 的局部极小值 (即对任意 $x_0 \in \mathbb{R}$ 存在 $\delta > 0$ 使得 $f(x) \geq f(x_0)$ for all $x \in (x_0 - \delta, x_0 + \delta)$). 证明 f 的值域是可数集, 即 $f(\mathbb{R})$ 是可数集。【本题或许用选择公理能较快获证.】

周P66:18 (关于紧集, 注意连续映射把紧集映为紧集)

18. 设映射 $f: \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}^d$ 连续, $E_k \subset \mathbb{R}^d$ 是非空紧集且递减: $E_1 \supset E_2 \supset E_3 \supset \dots$. 证明

$$f\left(\bigcap_{k=1}^{\infty} E_k\right) = \bigcap_{k=1}^{\infty} f(E_k).$$

周P68: 29 (关于覆盖).

29. 设 $K \subset \mathbb{R}^d$ 是有界闭集, $\{B_\alpha\}_{\alpha \in A}$ 是 K 的开球覆盖(即每个 B_α 是 \mathbb{R}^d 中的开球且 $K \subset \bigcup_{\alpha \in A} B_\alpha$). 试证明存在 $\delta > 0$ 使得对每个 $x \in K$ 都存在 $\alpha \in A$ 使得 $B(x, \varepsilon) \subset B_\alpha$.

这里 $B(x, \varepsilon) = \{y \in \mathbb{R}^d \mid |y - x| < \varepsilon\}$ (即是以 x 为中心、 ε 为半径的开球) .

§1.3. 广义实数运算

把正负无穷大 $\pm\infty$ 加入实数集 \mathbb{R} 中, 我们称

$$\mathbb{R} \cup \{\pm\infty\} = [-\infty, +\infty]$$

为广义实数集。在测度和积分论中, 不可避免地要与无穷大 $\pm\infty$ 打交道。例如无界直线的长度为正无穷大, 一些变量的极限是正(负)无穷大, 等等。

广义实数集中算术运算法则是 在常义实数集的运算法则基础增加以下约定 (对于 $x \in \mathbb{R}$):

$$\begin{aligned} -\infty < +\infty, \quad -(-\infty) &= +\infty, \quad |\pm\infty| = +\infty, \\ +\infty + (+\infty) &= +\infty - (-\infty) = -(-\infty) + (+\infty) = +\infty, \quad -\infty - (+\infty) = -\infty, \\ (+\infty) \cdot (+\infty) &= (-\infty) \cdot (-\infty) = +\infty, \quad (+\infty) \cdot (-\infty) = (-\infty) \cdot (+\infty) = -\infty, \\ x + \infty &= +\infty + x = +\infty, \quad x - \infty = -\infty + x = -\infty, \quad x \in \mathbb{R}; \\ x \cdot (+\infty) &= (+\infty) \cdot x = +\infty, \quad x \cdot (-\infty) = (-\infty) \cdot x = -\infty \quad \text{if} \quad x > 0, \\ x \cdot (+\infty) &= (+\infty) \cdot x = -\infty, \quad x \cdot (-\infty) = (-\infty) \cdot x = +\infty \quad \text{if} \quad x < 0, \\ 0 \cdot (\pm\infty) &= (\pm\infty) \cdot 0 = 0. \end{aligned} \tag{1.3.1}$$

但下列运算无定义:

$$“+\infty - (+\infty)” , \quad “-\infty + (+\infty)” , \quad “\frac{\pm\infty}{\pm\infty}”$$

注意以上约定与极限论 L' Hospital 法则中的不定型问题有区别. 最大的区别是: 在广义实数运算约定中, $0 \cdot (\pm\infty) = 0$ 中的 0 是常数 0, 而不是无穷小变量!

对于 $\frac{1}{0}, \frac{1}{\pm\infty}$, 则根据具体问题来定义其值. 例如若所考虑的集合是非负实数的子集, 而0是这集合中的最小数, 则定义 $\frac{1}{0} = \frac{1}{0+} = +\infty$. 又例如若 $\frac{1}{\pm\infty}$ 不与无穷大做乘法运算, 则可定义 $\frac{1}{\pm\infty} = 0$.

【注】当上下文清楚时, 常用 ∞ 代表 $+\infty$, 例如 $a < \infty$ 只可能是表示 $a < +\infty$, 又例如若 n 是自然数, 则 $n \rightarrow \infty$ 当然表示 $n \rightarrow +\infty$, $\sum_{n=1}^{\infty}$ 当然表示 $\sum_{n=1}^{+\infty}$, 等等.

• **广义非负实数和上确界:** 设 $A \subset [0, +\infty]$ 非空. 若 $+\infty \in A$ 或 $A \subset [0, +\infty)$ 无上界, 则我们定义 $\sup A = +\infty$.

关于广义非负实数, 常用的一个性质是: 单调增加的数列总有极限:

若 $0 \leq b_1 \leq b_2 \leq b_3 \leq \dots, b_n \in [0, +\infty]$, 则 $\lim_{n \rightarrow \infty} b_n = \sup_{n \geq 1} b_n$.

事实上当一切 $b_n \in [0, +\infty)$ 时, 这归结为常义极限问题. 若存在 N 使得 $b_N = +\infty$, 则 $b_n = +\infty \forall n \geq N$. 此时当然有 $\lim_{n \rightarrow \infty} b_n = +\infty = \sup_{n \geq 1} b_n$.

对于广义非负实数, 加法永远有定义. 在测度与积分中经常用到广义正项级数, 其定义与常义正项级数相同, 即为部分和的极限:

$$\sum_{k=1}^{\infty} a_k := \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{k=1}^n a_k, \quad \sum_{i=1}^{\infty} \sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j} := \lim_{m, n \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m a_{i,j}, \quad a_k, a_{i,j} \in [0, +\infty].$$

易见当 $a_k \in [0, +\infty] (k = 1, 2, \dots)$ 中有一项为 $+\infty$ 时, $\sum_{k=1}^{\infty} a_k = +\infty$.

【命题1.3.1(广义正项级数的求和及换序不变性)】 设 $\{a_k\}_{k=1}^{\infty}, \{a_{i,j}\}_{i,j=1}^{\infty}$ 为广义非负实数列. 则

$$\sum_{k=1}^{\infty} a_k = \sum_{k=1}^{\infty} a_{\sigma(k)}, \quad \sum_{i=1}^{\infty} \left(\sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j} \right) = \sum_{j=1}^{\infty} \left(\sum_{i=1}^{\infty} a_{i,j} \right) = \sum_{i=1}^{\infty} \sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j}$$

这里 $\{\sigma(k)\}_{k=1}^{\infty} = \mathbb{N}$ 是 \mathbb{N} 的任一排列. 让一些 a_k 和 $a_{i,j}$ 等于 0, 上式包括了任意有限求和的情形.

【证】 第一个等式的证明与常义正项级数的情形相同. 下证第二个等式. 由通项非负易见若某一项 $a_{i,j} = +\infty$, 则所有求和都等于 $+\infty$, 这时所证等式成立. 以下假设 $0 \leq a_{i,j} < \infty \forall i, j \geq 1$. 计算

$$\sum_{i=1}^n \left(\sum_{j=1}^m a_{i,j} \right) = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m a_{i,j} \leq \sum_{i=1}^{\infty} \sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j}.$$

注意一切 $a_{i,j} \geq 0$, 得到

$$\sum_{i=1}^n \left(\sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j} \right) = \sum_{i=1}^n \left(\lim_{m \rightarrow \infty} \sum_{j=1}^m a_{i,j} \right) = \lim_{m \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^n \left(\sum_{j=1}^m a_{i,j} \right) \leq \sum_{i=1}^{\infty} \sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j}.$$

再令 $n \rightarrow \infty$ 得到

$$\sum_{i=1}^{\infty} \left(\sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j} \right) \leq \sum_{i=1}^{\infty} \sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j}.$$

同理由

$$\sum_{i=1}^{\infty} \sum_{j=1}^m a_{i,j} = \sum_{i=1}^n \left(\sum_{j=1}^m a_{i,j} \right) \leq \sum_{i=1}^n \left(\sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j} \right) \leq \sum_{i=1}^{\infty} \left(\sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j} \right)$$

得到反向不等式

$$\sum_{i=1}^{\infty} \sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j} = \lim_{n,m \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m a_{i,j} \leq \sum_{i=1}^{\infty} \left(\sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j} \right).$$

所以 $\sum_{i=1}^{\infty} \left(\sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j} \right) = \sum_{i=1}^{\infty} \sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j}$. 同理可证 $\sum_{j=1}^{\infty} \left(\sum_{i=1}^{\infty} a_{i,j} \right) = \sum_{i=1}^{\infty} \sum_{j=1}^{\infty} a_{i,j}$. \square

• **广义实数集的上下确界和上下极限:** 对于任一非空广义实数集合 $A \subset [-\infty, +\infty]$, 若 $+\infty \in A$, 或 $A \subset [-\infty, +\infty)$ 但 A 没有有限的上界, 则定义 $\sup A = +\infty$; 若 $-\infty \in A$, 或 $A \subset (-\infty, +\infty]$ 但 A 没有有限的下界, 则定义 $\inf A = -\infty$.

对任一数列 $\{a_n\}_{n=1}^{\infty} \subset [-\infty, +\infty]$, 部分序列 $n \mapsto \{a_k\}_{k \geq n}$ 是单调的:

$$\{a_k\}_{k \geq n+1} \subset \{a_k\}_{k \geq n}, \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

因此

$$\sup_{k \geq n+1} a_k \leq \sup_{k \geq n} a_k, \quad \inf_{k \geq n+1} a_k \geq \inf_{k \geq n} a_k, \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

我们称

$$\limsup_{n \rightarrow \infty} a_n := \lim_{n \rightarrow \infty} \left(\sup_{k \geq n} a_k \right), \quad \liminf_{n \rightarrow \infty} a_n := \lim_{n \rightarrow \infty} \left(\inf_{k \geq n} a_k \right)$$

分别为 $\{a_n\}_{n=1}^{\infty}$ 的上极限和下极限.

与实数集性质相同, 我们称广义实数列 $\{a_n\}$ 有极限如果

$$\limsup_{n \rightarrow \infty} a_n = \liminf_{n \rightarrow \infty} a_n.$$

这时这个公共值即定义为 $\{a_n\}_{n=1}^{\infty}$ 的极限, 记做 $\lim_{n \rightarrow \infty} a_n := \limsup_{n \rightarrow \infty} a_n = \liminf_{n \rightarrow \infty} a_n$.

• **函数列的情形:** 设 $f_k : E \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 是 E 上一列广义实值函数. 对每一固定的 $x \in E$, $\{f_k(x)\}_{k=1}^{\infty}$ 就是一个广义实数列. 我们说 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 在 E 上逐点收敛, 如果

$$\limsup_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = \liminf_{k \rightarrow \infty} f_k(x) \quad \forall x \in E.$$

此时我们称这个公共极限

$$f(x) := \lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) := \limsup_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = \liminf_{k \rightarrow \infty} f_k(x) \quad \forall x \in E.$$

为 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 在 E 上的极限函数. 这里有两种情形: 一种是利用函数列来构造函数, 即这函数是函数列的极限函数, 另一种刚好相反: 对于已知函数, 构造满足一定条件的

函数列使得此函数列处处收敛于这个已知函数. 无论哪种情形, 说 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 在 E 上逐点收敛于 f 是指 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 在 E 上逐点收敛且

$$\lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = \varphi(x) \quad \forall x \in E.$$

注意这里“收敛”只是习惯说法, 事实上它包括了在某些点 x 处的极限等于 $+\infty, -\infty$ 的情形.

【例】

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{|\cos(\pi x)|^k}{1 - |\cos(\pi x)|^k} = \begin{cases} 0 & \text{if } x \in \mathbb{R} \setminus \mathbb{Z}, \\ +\infty & \text{if } x \in \mathbb{Z}. \end{cases}$$

在这个例子中我们已定义 $\frac{1}{0} = \frac{1}{0^+} = +\infty$, 这是因为 $1 - |\cos(\pi x)|^k \geq 0 \quad \forall x \in \mathbb{R}$.

§1.4. Lebesgue 外测度和测度

Lebesgue测度论是古典几何体的长度、面积、体积等丈量法的推广：对欧空间中大量的一般点集也可以赋予测度。测度的主要特征是可加性，即整体的测度等于部分测度之和。由于并非每个点集的子集之间具有可加性(见后面不可测集的例子)，因此必须对点集进行挑选，使得挑选后的点集类具有可加性。做这件事通常分两步：第一步先对任意点集建立外测度，第二步：在外测度的基础上增加一个限制(例如通常的Carathéodory 条件 或本教材中考虑的开集逼近 (二者是等价的))，使得由满足这个限制的点集组成的类具有可加性。

以下我们用 $\bigcup_{k \geq 1}, \sum_{k \geq 1}$ 表示可数并、可数和，即

$$\bigcup_{k \geq 1} = \bigcup_{k=1}^n \text{ 或 } = \bigcup_{k=1}^{\infty}; \quad \sum_{k \geq 1} = \sum_{k=1}^n \text{ 或 } = \sum_{k=1}^{\infty}.$$

【定义(\mathbb{R}^d 上的Lebesgue 外测度)】 设 $E \subset \mathbb{R}^d$. 称广义非负实数

$$m^*(E) = \inf \left\{ \sum_{k \geq 1} |I_k| \mid I_k \subset \mathbb{R}^d \text{ 是有界区间且 } \bigcup_{k \geq 1} I_k \supset E \right\}$$

为集合 E 的 d 维Lebesgue 外测度，简称外测度. \square

为了应用方便我们先给出

【命题1.4.1(外测度的等价定义)】 设 $E \subset \mathbb{R}^d, \delta > 0$. 令

$$\begin{aligned} m_{\text{open}}^*(E) &= \inf \left\{ \sum_{k \geq 1} |I_k| \mid I_k \subset \mathbb{R}^d \text{ 是有界开区间且 } \bigcup_{k \geq 1} I_k \supset E \right\}, \\ m_{\delta}^*(E) &= \inf \left\{ \sum_{k \geq 1} |I_k| \mid I_k \subset \mathbb{R}^d \text{ 是有界区间且 } \text{diam}(I_k) < \delta, \bigcup_{k \geq 1} I_k \supset E \right\}, \\ m_Q^*(E) &= \inf \left\{ \sum_{k \geq 1} |Q_k| \mid Q_k \subset \mathbb{R}^d \text{ 是有界闭方体且 } \bigcup_{k \geq 1} Q_k \supset E \right\}. \end{aligned}$$

则有

$$m^*(E) = m_{\text{open}}^*(E) = m_{\delta}^*(E) = m_Q^*(E).$$

为证这一命题，先证一个引理.

【引理1.4.2(乘积的连续性)】 设 a_i, b_i 为实数或复数($i = 1, 2, \dots, d$). 则

$$\left| \prod_{i=1}^d a_i - \prod_{i=1}^d b_i \right| \leq M^{d-1} \sum_{i=1}^d |a_i - b_i| \quad (1.4.1)$$

其中 $M = \max_{1 \leq i \leq d} \{|a_i|, |b_i|\}$.

【证】我们对乘积因子个数 d 用归纳法. 当 $d = 1$ 时不等式(1.4.1) 是显然的, 其中规定 $0^0 = 1$. 假设不等式(1.4.1) 对于因子个数 $= d$ 时成立. 记 $M_k = \max_{1 \leq i \leq k} \{|a_i|, |b_i|\}$. 做分拆

$$\prod_{i=1}^{d+1} a_i - \prod_{i=1}^{d+1} b_i = \left(\prod_{i=1}^d a_i - \prod_{i=1}^d b_i \right) a_{d+1} + \left(\prod_{i=1}^d b_i \right) (a_{d+1} - b_{d+1})$$

则由归纳假设得到

$$\begin{aligned} \left| \prod_{i=1}^{d+1} a_i - \prod_{i=1}^{d+1} b_i \right| &\leq (M_d)^{d-1} \left(\sum_{i=1}^d |a_i - b_i| \right) |a_{d+1}| + (M_d)^d |a_{d+1} - b_{d+1}| \\ &\leq (M_{d+1})^d \left(\sum_{i=1}^d |a_i - b_i| + |a_{d+1} - b_{d+1}| \right) = (M_{d+1})^d \sum_{i=1}^{d+1} |a_i - b_i|. \end{aligned}$$

由归纳法原理, (1.4.1) 普遍成立. \square

【外测度定义等价性的证明】首先由下确界的定义(集合越小其下确界越大)有

$$m^*(E) \leq m_{\text{open}}^*(E), \quad m^*(E) \leq m_{\delta}^*(E), \quad m^*(E) \leq m_Q^*(E).$$

下证反向不等式也成立:

$$m_{\text{open}}^*(E) \leq m^*(E), \quad m_{\delta}^*(E) \leq m^*(E), \quad m_Q^*(E) \leq m^*(E).$$

任取 $E \subset \mathbb{R}^d$. 若 $m^*(E) = +\infty$, 则反向不等式显然成立. 设 $m^*(E) < \infty$. 由 $m^*(E)$ 的定义, 对任意 $\varepsilon > 0$ (可设 $\varepsilon < 1$), 存在 E 的一个有界区间覆盖 $\{I_k\}_{k \geq 1}$ 使得

$$\sum_{k \geq 1} |I_k| < m^*(E) + \varepsilon.$$

写 $\overline{I_k} = \prod_{i=1}^d [a_{k,i}, b_{k,i}]$. 考虑包含 I_k 的开区间 J_k :

$$J_k = \prod_{i=1}^d (a_{k,i} - \delta_k, b_{k,i} + \delta_k), \quad \delta_k = \frac{1}{[\max_{1 \leq i \leq d} (b_{k,i} - a_{k,i} + 1)]^{d-1}} \cdot \frac{\varepsilon}{d \cdot 2^{k+1}}, \quad k \geq 1.$$

则 $\{J_k\}_{k \geq 1}$ 是 E 的一个有界开区间覆盖. 而由引理1.4.2(乘积的连续性) 有

$$\begin{aligned} |J_k| - |I_k| &= \prod_{i=1}^d (b_{k,i} - a_{k,i} + 2\delta_k) - \prod_{i=1}^d (b_{k,i} - a_{k,i}) \\ &\leq [\max_{1 \leq i \leq d} (b_{k,i} - a_{k,i} + 1)]^{d-1} \cdot d \cdot 2\delta_k = \frac{\varepsilon}{2^k} \end{aligned}$$

\implies

$$m_{\text{open}}^*(E) \leq \sum_{k \geq 1} |J_k| \leq \sum_{k \geq 1} |I_k| + \sum_{k \geq 1} \frac{\varepsilon}{2^k} < m^*(E) + \varepsilon + \varepsilon = m^*(E) + 2\varepsilon.$$

由 $\varepsilon > 0$ 的任意性, 令 $\varepsilon \rightarrow 0+$ 知 $m_{\text{open}}^*(E) \leq m^*(E)$ 。

又对每个区间 I_k , 根据上节中的**区间的分划**知, 存在正整数 N_k 使得 I_k 被分割成 N_k 个互不重叠的子区间的并: $I_k = \bigcup_{j=1}^{N_k} I_{k,j}$, $|I_k| = \sum_{j=1}^{N_k} |I_{k,j}|$ 且满足 $\text{diam}(I_{k,j}) < \delta$, $j = 1, 2, \dots, N_k$. 易见 $\{I_{k,j} \mid k \geq 1, j = 1, 2, \dots, N_k\}$ 是 E 的可数覆盖: $\bigcup_{k \geq 1} \bigcup_{j=1}^{N_k} I_{k,j} = \bigcup_{k \geq 1} I_k \supset E$. 于是有

$$m_{\delta}^*(E) \leq \sum_{k \geq 1} \sum_{j=1}^{N_k} |I_{k,j}| = \sum_{k \geq 1} \left(\sum_{j=1}^{N_k} |I_{k,j}| \right) = \sum_{k \geq 1} |I_k| < m^*(E) + \varepsilon.$$

再由 $\varepsilon > 0$ 的任意性即知 $m_{\delta}^*(E) \leq m^*(E)$. 以上证明了 $m^*(E) = m_{\text{open}}^*(E) = m_{\delta}^*(E)$.

最后证明 $m_Q^*(E) \leq m^*(E)$ 。我们将提前使用下面将证明的**可加性和外测度保持区间体积**的性质。不难看到这样做是安全的因为在后面的证明中我们将只用到已证明的性质, 不会有逻辑循环。

对任意 $\varepsilon > 0$, 由 $m^*(E) = m_{\text{open}}^*(E)$ 知存在 E 的有界开区间覆盖 $\bigcup_{k \geq 1} I_k \supset E$ 使得

$$\sum_{k \geq 1} |I_k| < m^*(E) + \varepsilon.$$

对于开集 $\bigcup_{k \geq 1} I_k$, 由**定理1.2.2(开集的方体分解)**知存在可数多个互不重叠的2-进闭方体 Q_j 使得 $\bigcup_{k \geq 1} I_k = \bigcup_{j=1}^{\infty} Q_j$. 于是由 Q_j 的可测性和互不重叠以及 $m^*(Q_j) = |Q_j|$ 和 $m_Q^*(E)$ 的定义得到

$$\begin{aligned} m_Q^*(E) &\leq \sum_{j=1}^{\infty} |Q_j| = \sum_{j=1}^{\infty} m^*(Q_j) = m^*\left(\bigcup_{j=1}^{\infty} Q_j\right) \\ &= m^*\left(\bigcup_{k \geq 1} I_k\right) \leq \sum_{k \geq 1} m^*(I_k) = \sum_{k \geq 1} |I_k| < m^*(E) + \varepsilon. \end{aligned}$$

再由 $\varepsilon > 0$ 的任意性即得 $m_Q^*(E) \leq m^*(E)$. \square

【命题1.4.3(Lebesgue 外测度的基本性质)】

(a) $m^*(\emptyset) = 0$, 即空集的外测度为零.

(b) 单调性:

$$\text{若 } A \subset B, \text{ 则 } m^*(A) \leq m^*(B).$$

(c) 次可加性: 对任意可数多个 $E_k \subset \mathbb{R}^d$ 有

$$m^*\left(\bigcup_{k \geq 1} E_k\right) \leq \sum_{k \geq 1} m^*(E_k).$$

(d) 隔离可加性: 对任意 $A, B \subset \mathbb{R}^d$,

$$\text{若 } \text{dist}(A, B) > 0, \text{ 则 } m^*(A \cup B) = m^*(A) + m^*(B).$$

(e) 保持区间体积:

$$\text{对任意有界区间 } I \subset \mathbb{R}^d \text{ 都有 } m^*(I) = |I|.$$

【证】 先证(b),(c). 设 $B \supset A$. 则有

$$\begin{aligned} & \left\{ \sum_{k \geq 1} |I_k| \mid I_k \subset \mathbb{R}^d \text{ 是有界区间且 } \bigcup_{k \geq 1} I_k \supset B \right\} \\ & \subset \left\{ \sum_{k \geq 1} |I_k| \mid I_k \subset \mathbb{R}^d \text{ 是有界区间且 } \bigcup_{k \geq 1} I_k \supset A \right\} \end{aligned}$$

因此由下确界的性质知

$$m^*(B) \geq m^*(A).$$

为证次可加性不等式, 可以假设 $\sum_{k \geq 1} m^*(E_k) < \infty$, 否则不等式显然成立。对任意 $\varepsilon > 0$ 和任意 $k \geq 1$, 由 $m^*(E_k)$ 和下确界的定义, 存在可数多个有界区间 $\{I_{k,j}\}_{j \geq 1}$ 满足 $\bigcup_{j \geq 1} I_{k,j} \supset E_k$ 使得

$$\sum_{j \geq 1} |I_{k,j}| < m^*(E_k) + \frac{\varepsilon}{2^k}.$$

易见 $\{I_{k,j}\}_{k \geq 1, j \geq 1}$ 覆盖了 E , 即

$$\bigcup_{k \geq 1, j \geq 1} I_{k,j} = \bigcup_{k \geq 1} \bigcup_{j \geq 1} I_{k,j} \supset \bigcup_{k \geq 1} E_k.$$

因此由 m^* 的定义有

$$m^*\left(\bigcup_{k \geq 1} E_k\right) \leq \sum_{k \geq 1} \sum_{j \geq 1} |I_{j,k}| = \sum_{k \geq 1} \left(\sum_{j \geq 1} |I_{k,j}| \right) < \sum_{k \geq 1} \left(m^*(E_k) + \frac{\varepsilon}{2^k} \right) \leq \sum_{k \geq 1} m^*(E_k) + \varepsilon.$$

以上用到非负二重级数求和的累次求和可换序的性质. 据 $\varepsilon > 0$ 的任意性知 $m^*(\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k) \leq \sum_{k=1}^{\infty} m^*(E_k)$.

来证(a). 因空集 \emptyset 是任何集合的子集, 故对任一点 $x_0 = (x_{01}, x_{02}, \dots, x_{0d}) \in \mathbb{R}^d$ 都有 $\emptyset \subset \{x_0\}$ 后者为单点集. 于是由 m^* 的单调性有 $m^*(\emptyset) \leq m^*(\{x_0\})$. 于是只需证明 $m^*(\{x_0\}) = 0$. 而这是显然的: 对任意 $\varepsilon > 0$ 有

$$\{x_0\} \subset \prod_{i=1}^d (x_{0i} - \varepsilon, x_{0i} + \varepsilon)$$

据外测度的定义得

$$m^*(\{x_0\}) \leq \left| \prod_{i=1}^d (x_{0i} - \varepsilon, x_{0i} + \varepsilon) \right| = (2\varepsilon)^d.$$

令 $\varepsilon \rightarrow 0+$ 即知 $m^*(\{x_0\}) = 0$.

下证(c)(隔离可加性): 设 $A, B \subset \mathbb{R}^d$ 满足 $\text{dist}(A, B) > 0$. 由次可加性有 $m^*(A \cup B) \leq m^*(A) + m^*(B)$. 为证反向不等式 $m^*(A) + m^*(B) \leq m^*(A \cup B)$ 可以假定 A, B 皆非空且 $m^*(A \cup B) < \infty$ (否则显然成立).

取 $0 < \delta < \text{dist}(A, B)$. 对任意 $\varepsilon > 0$, 由 $m^* = m_\delta^*$ 知存在 $A \cup B$ 的一个区间可数覆盖 $\{I_k\}_{k \geq 1}$ 满足 $\text{diam}(I_k) < \delta$ 使得

$$\sum_{k \geq 1} |I_k| < m^*(A \cup B) + \varepsilon.$$

令

$$\mathbb{N}_A = \{k \mid I_k \cap A \neq \emptyset\}, \quad \mathbb{N}_B = \{k \mid I_k \cap B \neq \emptyset\}.$$

则由 $0 < \delta < \text{dist}(A, B)$ 和 $\text{diam}(I_k) < \delta$ 易证

$$\mathbb{N}_A \cap \mathbb{N}_B = \emptyset \quad \text{从而有} \quad A \subset \bigcup_{k \in \mathbb{N}_A} I_k, \quad B \subset \bigcup_{k \in \mathbb{N}_B} I_k.$$

[自补证明, 反证法.] 于是得到

$$m^*(A) + m^*(B) \leq \sum_{k \in \mathbb{N}_A} |I_k| + \sum_{k \in \mathbb{N}_B} |I_k| \leq \sum_{k \geq 1} |I_k| < m^*(A \cup B) + \varepsilon.$$

令 $\varepsilon \rightarrow 0$ 即得反向不等式 $m^*(A) + m^*(B) \leq m^*(A \cup B)$. 所以 $m^*(A \cup B) = m^*(A) + m^*(B)$.

最后证(e) (保持区间体积): 设 $I \subset \mathbb{R}^d$ 为任一有界区间. 因区间 I 覆盖了 I 自己, 故由Lebesgue外测度的定义知 $m^*(I) \leq |I|$. 为证反向不等式, 先设 I 是闭区间. 对任意 $\varepsilon > 0$, 由 $m^* = m_{\text{open}}^*$ 知存在 I 的有界开区间可数覆盖 $\{I_k\}_{k \geq 1}$ 使得

$$\sum_{k \geq 1} |I_k| < m^*(I) + \varepsilon.$$

因 I 是紧集(因 I 是有界闭区间), 故由紧集的有限覆盖定理知存在 $N \in \mathbb{N}$ 使得

$$I \subset \bigcup_{k=1}^N I_k.$$

于是据命题1.2.3(区间的估计) 有

$$|I| \leq \sum_{k=1}^N |I_k| \leq \sum_{k \geq 1} |I_k| < m^*(I) + \varepsilon.$$

据 $\varepsilon > 0$ 的任意性即得 $|I| \leq m^*(I)$. 对于一般情形, 将 I 表为 $I = \prod_{i=1}^d (a_i, b_i)$ 或 $\prod_{i=1}^d [a_i, b_i]$ 等等. 考虑 I 的内闭逼近:

$$I_n = \prod_{i=1}^d \left[a_i + \frac{1}{2n}, b_i - \frac{1}{2n} \right], \quad \frac{1}{n} < \max_{1 \leq i \leq d} (b_i - a_i).$$

则由闭区间的结果和 m^* 的单调性有

$$\prod_{i=1}^d (b_i - a_i - \frac{1}{n}) = |I_n| \leq m^*(I_n) \leq m^*(I).$$

令 $n \rightarrow \infty$ 即得

$$|I| = \prod_{i=1}^d (b_i - a_i) = \lim_{n \rightarrow \infty} |I_n| \leq m^*(I).$$

因此反向不等式 $|I| \leq m^*(I)$ 也成立。 \square

【注】 由Lebesgue外测度 m^* 保持区间体积 易证两个常用性质(学生自证):

- (1) 若 E 有内点, 即 $E^\circ \neq \emptyset$, 则 $m^*(E) > 0$.
- (2) 若 E 有界, 则 $m^*(E) < \infty$.

• Lebesgue 可测集和测度

为了兼顾一般测度论的学习, 我们对可测集给出两个等价的定义。

【可测集和测度的定义】 设 $E \subset \mathbb{R}^d$.

定义1 —— 开集逼近: 若对任意 $\varepsilon > 0$ 存在开集 $\mathcal{O} \supset E$ 使得

$$m^*(\mathcal{O} \setminus E) < \varepsilon$$

则称 E 是一个 d 维 Lebesgue 可测集, 简称为 d 维 L -可测集或 L -可测集。

定义2 —— Carathéodory 条件: 设 $E \subset \mathbb{R}^d$. 若 E 满足 Carathéodory 条件, 即

$$m^*(T) = m^*(T \cap E) + m^*(T \cap E^c) \quad \forall T \subset \mathbb{R}^d \quad (\text{C})$$

则称 E 是一个 d 维 Lebesgue 可测集, 简称为 d 维 L -可测集或 L -可测集。 条件(C)中的集合 T 称为检验集(testing set)。

\mathbb{R}^d 中的 Lebesgue 可测集的全体记作 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 外测度 m^* 在 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 上的限制 $m = m^*|_{\mathcal{M}(\mathbb{R}^d)}$, 即

$$m(E) = m^*(E), \quad E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$$

称为 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 上的 Lebesgue 测度, 简称为 d 维 Lebesgue 测度 或 \mathbb{R}^d 上的 L -测度 \square

定义1 给出了可测集的结构: 可测集是开集的极限; 而定义2则迫使可测集具有可加性, 预示了可测集类具有可加性。下面证明这两个定义是等价的。先证一个引理:

【引理1.4.6】 设集合 $E_k \subset \mathbb{R}^d$ 和 $E = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k$ 满足

$$E_k \subset E_{k+1}, \quad \text{dist}(E_k, E \setminus E_{k+1}) > 0, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

则有

$$m^*(E) = \lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k).$$

【证】 首先由 $E_k \nearrow$ 和外测度的单调性有

$$m^*(E_k) \leq m^*(E_{k+1}) \leq m^*(E), \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

因此极限 $\lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k)$ 存在且 $\leq m^*(E)$.

若 $\lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k) = +\infty$, 则这蕴含 $m^*(E) = +\infty$ 从而有 $\lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k) = +\infty = m^*(E)$.

下设 $\lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k) < \infty$. 由外测度的单调性知 $m^*(E_k) \leq \lim_{j \rightarrow \infty} m^*(E_j) < \infty, k = 1, 2, 3, \dots$. 因此在下面推导中没有 $+\infty$ 参与运算. 令

$$E_0 = \emptyset, \quad A_k = E_k \setminus E_{k-1}, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

则由 $E_k \nearrow$ 易见有

$$E = E_k \cup \bigcup_{j=k+1}^{\infty} A_j$$

从而由外测度的次可加性有

$$m^*(E) \leq m^*(E_k) + \sum_{j=k+1}^{\infty} m^*(A_j), \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

下面我们将证明正项级数 $\sum_{j=1}^{\infty} m^*(A_j) < \infty$ (即级数收敛). 如果此事成立, 则由级数收敛蕴含其尾巴趋于零: $\lim_{k \rightarrow \infty} \sum_{j=k+1}^{\infty} m^*(A_j) = 0$, 得到

$$m^*(E) \leq \lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k) + \lim_{k \rightarrow \infty} \sum_{j=k+1}^{\infty} m^*(A_j) = \lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k).$$

即反向不等式也成立. 于是等式 $m^*(E) = \lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k)$ 成立.

下证 $\sum_{k=1}^{\infty} m^*(A_k)$ 收敛. 因 $A_k \subset E_k, A_{k+2} \subset E \setminus E_{k+1}$, 故由引理假设有

$$\text{dist}(A_k, A_{k+2}) \geq \text{dist}(E_k, E \setminus E_{k+1}) > 0.$$

于是由 m^* 的隔离可加性有

$$m^*(A_k \cup A_{k+2}) = m^*(A_k) + m^*(A_{k+2}), \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

这给出

$$m^*(A_{2k-1} \cup A_{2k+1}) = m^*(A_{2k-1}) + m^*(A_{2k+1}), \quad k = 1, 2, 3, \dots,$$

$$m^*(A_{2k} \cup A_{2k+2}) = m^*(A_{2k}) + m^*(A_{2k+2}), \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

假设对于 $n \in \mathbb{N}$ 已有

$$m^*\left(\bigcup_{k=1}^n A_{2k-1}\right) = \sum_{k=1}^n m^*(A_{2k-1}), \quad m^*\left(\bigcup_{k=1}^n A_{2k}\right) = \sum_{k=1}^n m^*(A_{2k}). \quad (1.4.2)$$

则由

$$\bigcup_{k=1}^n A_{2k-1} \subset E_{2n-1}, \quad A_{2n+1} \subset E \setminus E_{2n},$$

$$\bigcup_{k=1}^n A_{2k} \subset E_{2n}, \quad A_{2n+2} \subset E \setminus E_{2n+1}$$

知

$$\text{dist}\left(\bigcup_{k=1}^n A_{2k-1}, A_{2n+1}\right) \geq \text{dist}(E_{2n-1}, E \setminus E_{2n}) > 0,$$

$$\text{dist}\left(\bigcup_{k=1}^n A_{2k}, A_{2n+2}\right) \geq \text{dist}(E_{2n}, E \setminus E_{2n+1}) > 0,$$

于是由 m^* 的隔离可加性和归纳假设有

$$m^*\left(\bigcup_{k=1}^{n+1} A_{2k-1}\right) = m^*\left(\bigcup_{k=1}^n A_{2k-1}\right) + m^*(A_{2n+1}) = \sum_{k=1}^{n+1} m^*(A_{2k-1}),$$

$$m^*\left(\bigcup_{k=1}^{n+1} A_{2k}\right) = m^*\left(\bigcup_{k=1}^n A_{2k}\right) + m^*(A_{2n+2}) = \sum_{k=1}^{n+1} m^*(A_{2k}).$$

据归纳法原理, (1.4.2)对所有 $n \in \mathbb{N}$ 成立.

由(1.4.2)和外测度的单调性有

$$\sum_{k=1}^n m^*(A_{2k-1}) = m^*\left(\bigcup_{k=1}^n A_{2k-1}\right) \leq m^*(E_{2n-1}) \leq \lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k)$$

$$\sum_{k=1}^n m^*(A_{2k}) = m^*\left(\bigcup_{k=1}^n A_{2k}\right) \leq m^*(E_{2n}) \leq \lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k)$$

因此

$$\sum_{k=1}^{\infty} m^*(A_k) = \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{k=1}^n m^*(A_k) \leq 2 \lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k) < \infty.$$

这证明了级数 $\sum_{k=1}^{\infty} m^*(A_k)$ 收敛. \square

【可测集两个定义的等价性的证明:】

先证明开集满足Carathéodory 条件(C). 任取开集 $\mathcal{O} \in \mathbb{R}^d$. 令 $F = \mathcal{O}^c = \mathbb{R}^d \setminus \mathcal{O}$. 则 F 是 \mathbb{R}^d 中的闭集. 对任意 $T \subset \mathbb{R}^d$, 令¹

$$E = T \setminus F, \quad E_k = \{x \in E \mid \text{dist}(x, F) \geq \frac{1}{k}\}, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

则有

$$E_k \subset E_{k+1}, \quad k = 1, 2, 3, \dots; \quad E = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k.$$

¹当 $F = \emptyset$ (空集)时, 我们定义 $\text{dist}(x, \emptyset) = +\infty$

事实上显然有 $E_k \subset E_{k+1} \subset E$, $k = 1, 2, 3, \dots$. 这蕴含 $\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k \subset E$. 而对任意 $x \in E$ 有 $x \notin F$. 因 F 是闭集, 故有 $\text{dist}(x, F) > 0$ 从而对于自然数 $k > \frac{1}{\text{dist}(x, F)}$ 有 $\text{dist}(x, F) > \frac{1}{k}$, 因此 $x \in E_k \subset \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k$. 所以 $E \subset \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k$. 所以 $E = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k$.

对任意 $x \in E_k, y \in E \setminus E_{k+1}$, 由定义有 $\text{dist}(x, F) \geq \frac{1}{k}, \text{dist}(y, F) < \frac{1}{k+1}$. 因此

$$|x - y| \geq |\text{dist}(x, F) - \text{dist}(y, F)| \geq \frac{1}{k} - \frac{1}{k+1} = \frac{1}{k(k+1)}.$$

因此

$$\text{dist}(E_k, E \setminus E_{k+1}) = \inf_{x \in E_k, y \in E \setminus E_{k+1}} |x - y| \geq \frac{1}{k(k+1)} > 0.$$

据引理1.4.6 知

$$\lim_{k \rightarrow \infty} m^*(E_k) = m^*(E).$$

又因

$$\text{dist}(E_k, T \cap F) = \inf_{x \in E_k} \text{dist}(x, T \cap F) \geq \inf_{x \in E_k} \text{dist}(x, F) \geq \frac{1}{k} > 0$$

故由 m^* 的隔离可加性有

$$m^*(E_k \cup (T \cap F)) = m^*(E_k) + m^*(T \cap F).$$

注意到 $E_k \cup (T \cap F) \subset T$, 因此

$$m^*(T) \geq m^*(E_k) + m^*(T \cap F) \rightarrow m^*(E) + m^*(T \cap F) \quad \text{as } k \rightarrow \infty.$$

因此再由 $E = T \setminus F = T \cap \mathcal{O}$, $T \cap F = T \cap \mathcal{O}^c$ 得到

$$m^*(T) \geq m^*(T \cap \mathcal{O}) + m^*(T \cap \mathcal{O}^c) \geq m^*(T).$$

所以 $m^*(T \cap \mathcal{O}) + m^*(T \cap \mathcal{O}^c) = m^*(T)$, 即 \mathcal{O} 满足条件(C).

现在设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 满足定义1, 即 E 可被开集逼近. 来证 E 满足条件(C). 任取 $T \subset \mathbb{R}^d$, 由

$$T = (T \cap E) \cup (T \cap E^c)$$

和外测度的次可加性有 $m^*(T) \leq m^*(T \cap E) + m^*(T \cap E^c)$. 来证反向不等式也成立:

$$m^*(T) \geq m^*(T \cap E) + m^*(T \cap E^c).$$

取开集序列 $\mathcal{O}_n \supset E$ 使得

$$\mathcal{O}_n \supset E, \quad m^*(\mathcal{O}_n \setminus E) < \frac{1}{n}, \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

因 \mathcal{O}_n 满足条件(C), 故有

$$m^*(T) = m^*(T \cap \mathcal{O}_n) + m^*(T \cap \mathcal{O}_n^c) \geq m^*(T \cap E) + m^*(T \cap \mathcal{O}_n^c).$$

易见

$$T \cap E^c \subset (T \cap \mathcal{O}_n^c) \cup (\mathcal{O}_n^c \setminus E) \quad \text{即} \quad T \setminus E \subset (T \setminus \mathcal{O}_n) \cup (\mathcal{O}_n^c \setminus E)$$

因此

$$m^*(T \cap E^c) \leq m^*(T \cap \mathcal{O}_n^c) + m^*(\mathcal{O}_n^c \setminus E) < m^*(T \cap \mathcal{O}_n^c) + \frac{1}{n}$$

于是得到

$$m^*(T) \geq m^*(T \cap E) + m^*(T \cap E^c) - \frac{1}{n}, \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

令 $n \rightarrow \infty$ 即得反向不等式. 所以 E 满足条件(C).

反之设 E 满足条件(C), 来证 E 可被开集逼近. 先设 $m^*(E) < \infty$. 对任意 $\varepsilon > 0$, 存在有界开区间覆盖 $\bigcup_{k \geq 1} I_k \supset E$ 使得

$$\sum_{k \geq 1} |I_k| < m^*(E) + \varepsilon.$$

令 $\mathcal{O} = \bigcup_{k \geq 1} I_k$, 则 \mathcal{O} 是开集且 $\mathcal{O} \supset E$. 取检验集 $T = \mathcal{O}$, 则有

$$m^*(\mathcal{O}) = m^*(\mathcal{O} \cap E) + m^*(\mathcal{O} \cap E^c) = m^*(E) + m^*(\mathcal{O} \setminus E)$$

因此

$$m^*(\mathcal{O} \setminus E) = m^*(\mathcal{O}) - m^*(E) \leq \sum_{k \geq 1} m^*(I_k) - m^*(E) = \sum_{k \geq 1} |I_k| - m^*(E) < \varepsilon.$$

这证明了 E 可被开集逼近. 其次设 E 无界. 考虑有界子集 $E_n = E \cap [-n, n]^d$. 对任意 $\varepsilon > 0$, 如上, 存在开集 $\mathcal{O}_n := \bigcup_{k \geq 1} I_{n,k} \supset E_n$ 使得

$$\sum_{k \geq 1} |I_{n,k}| < m^*(E_n) + \frac{\varepsilon}{2^n}.$$

取检验集 $T = \mathcal{O}_n$ 便有

$$m^*(\mathcal{O}_n) = m^*(\mathcal{O}_n \cap E) + m^*(\mathcal{O}_n \setminus E) \geq m^*(E_n) + m^*(\mathcal{O}_n \setminus E)$$

从而有

$$\begin{aligned} m^*(\mathcal{O}_n \setminus E) &\leq m^*(\mathcal{O}_n) - m^*(E_n) \leq \sum_{k \geq 1} m^*(I_{n,k}) - m^*(E_n) \\ &= \sum_{k \geq 1} |I_{n,k}| - m^*(E_n) < \frac{\varepsilon}{2^n}. \end{aligned}$$

令 $\mathcal{O} = \bigcup_{n=1}^{\infty} \mathcal{O}_n$, 则 \mathcal{O} 是开集且包含了 E : $\mathcal{O} = \bigcup_{n=1}^{\infty} \mathcal{O}_n \supset \bigcup_{n=1}^{\infty} E_n = E$. 又显然有

$$\mathcal{O} \setminus E = \bigcup_{n=1}^{\infty} (\mathcal{O}_n \setminus E)$$

于是有

$$m^*(\mathcal{O} \setminus E) \leq \sum_{n=1}^{\infty} m^*(\mathcal{O}_n \setminus E) < \sum_{n=1}^{\infty} \frac{\varepsilon}{2^n} = \varepsilon.$$

所以 E 可以被开集逼近. 这就证明了上述两个定义的等价性. \square

【定义(零测集)】 若 $E \subset \mathbb{R}^d$ 且 $m^*(E) = 0$, 则称 E 是一个 d 维 Lebesgue 零测集 (set of measure zero) 或零集 (null set). \square

零测集在测度论研究中具有重要作用. 下面命题给出零测集的基本性质.

【命题1.4.7(Lebesgue零测集的基本性质)】

- (a) 可数个 (d 维) 零测集的并集还是 (d 维) 零测集.
 - (b) 可数集是零测集. 特别, \mathbb{Q}^d (有理点集) 是零测集.
 - (c) 设 p, q 为正整数, $d = p + q$. 假设 Z_p, Z_q 分别是 \mathbb{R}^p 中的 p 维零测集和 \mathbb{R}^q 中的 q 维零测集, 则 $Z_p \times \mathbb{R}^q$ 和 $\mathbb{R}^p \times Z_q$ 都是 \mathbb{R}^d 中的 d 维零测集.
- 因此对任意 $A \subset \mathbb{R}^p, B \subset \mathbb{R}^q$, 集合 $A \times Z_q$ 和 $Z_p \times B$ 都是 \mathbb{R}^d 中的 d 维零测集.
- (d) 若 $d \geq 2$, 则 \mathbb{R}^d 中维数 $< d$ 的线性子空间及其平移都是 d 维零测集.

【证】 (a): 设 Z_k 是零测集, $m^*(Z_k) = 0$. 则由次可加性有

$$0 \leq m^*\left(\bigcup_{k \geq 1} Z_k\right) \leq \sum_{k \geq 1} m^*(Z_k) = 0.$$

(b): 设 $Z = \{x_k\}_{k \geq 1}$ 是一个可数集. 我们前面已证明了单点集是零测集, 故有 $m^*(\{x_k\}) = 0$. 把 Z 写成单点集的并: $Z = \bigcup_{k \geq 1} \{x_k\}$ 即知 Z 是零测集.

(c): 先证明若 $J \subset \mathbb{R}^q$ 是任意有界区间, 例如 $J = [-R, R]^q$, 则 $Z_p \times J$ 是 d 维零测集.

事实上对任意 $\varepsilon > 0$, 由 Z_p 是 \mathbb{R}^p 中的 p 维零测集, 存在 Z_p 的区间覆盖 $\{I_k\}_{k \geq 1}$ 使得 $\sum_{k \geq 1} |I_k| < \varepsilon$. 因区间的乘积还是区间, 故 $\{I_k \times J\}_{k \geq 1}$ 是 $Z_p \times J$ 的有界区间覆盖, 从而有

$$m^*(Z_p \times J) \leq \sum_{k \geq 1} |I_k \times J| = \sum_{k \geq 1} |I_k| |J| = \left(\sum_{k \geq 1} |I_k| \right) |J| < \varepsilon |J|.$$

令 $\varepsilon \rightarrow 0$ 即得 $m^*(Z_p \times J) = 0$. 因此 $Z_p \times J$ 是 d 维零测集.

现在令 $J_k = [-k, k]^q, k \in \mathbb{N}$, 则 $Z_p \times J_k$ 是 d 维零测集且

$$Z_p \times \mathbb{R}^q = \bigcup_{k=1}^{\infty} Z_p \times J_k.$$

上式表明 $Z_p \times \mathbb{R}^q$ 等于可数多个 d 维零测集的并集, 因此 $Z_p \times \mathbb{R}^q$ 是 d 维零测集. 同法可证 $\mathbb{R}^p \times Z_q$ 是 d 维 L -零测集.

(d): 这个证明将在定理1.5.3(平移和线性变换下Lebesgue测度的计算公式)之后完成, 其间没有循环论证. \square

【例】 任何区间 $I \subset \mathbb{R}^d$ 的边界 ∂I 是 d 维零测集即 $m^*(\partial I) = 0$.

事实上由区间的定义知边界 ∂I 是 d 个形如 $A \times I, I_1 \times B \times I_2, I \times C$ 的集合的并集, 其中 A, B, C 是 \mathbb{R} 中只含两元素的有限集, I 是 \mathbb{R}^{d-1} 中的区间, 而当 $d \geq 3$ 时, I_1, I_2 分别是 $\mathbb{R}^p, \mathbb{R}^q$ 中的区间其中 $p + q = d - 1$. 由上述命题1.4.7(Lebesgue 零测集的基本性质)(c) 知 $A \times I, I \times C$ 都是 d 维零测集. 同理 $I_1 \times B$ 是 $p + 1$ 维零测集, 于是再由上述命题知 $I_1 \times B \times I_2 = (I_1 \times B) \times I_2$ 是 d 维零测集. 所以 ∂I 是 d 维零测集. \square

【定理1.4.8(Lebesgue可测集和测度的基本性质)】 设 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 是 \mathbb{R}^d 中的Lebesgue 可测集的全体, $m = m^*|_{\mathcal{M}(\mathbb{R}^d)}$ 是 \mathbb{R}^d 上的 d 维Lebesgue 测度. 则有

- (a) \mathbb{R}^d 中的每个开集属于 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 特别有 $\mathbb{R}^d \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.
- (b) 若 $E \subset \mathbb{R}^d$ 且 $m^*(E) = 0$, 则 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 即零测集是可测集. 特别有 $\emptyset \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.
- (c) 若 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 则 $E^c \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.
- (d) 若 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d), k = 1, 2, \dots, n$ 或 $k = 1, 2, 3, \dots$, 则 $\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.

若进一步假设 E_k 互不相交, 则成立可加性:

$$m\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k\right) = \sum_{k=1}^{\infty} m(E_k).$$

(e) 次可加性: 对任意 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d), k = 1, 2, \dots, n$ 或 $k = 1, 2, 3, \dots$, 有

$$m\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k\right) \leq \sum_{k=1}^{\infty} m(E_k).$$

(f) 减法运算: 若 $m(A \cap B) < \infty$ 则

$$m(B \setminus A) = m(B) - m(A \cap B), \quad m(A \cup B) = m(A) + m(B) - m(A \cap B).$$

特别

当 $A \subset B$ 且 $m(A) < \infty$ 时有 $m(B \setminus A) = m(B) - m(A)$.

(g) **单调极限:** 设 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $k = 1, 2, 3, \dots$.

若 $E_1 \subset E_2 \subset E_3 \subset \dots$, 则 $m\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k\right) = \lim_{k \rightarrow \infty} m(E_k)$.

若 $E_1 \supset E_2 \supset E_3 \supset \dots$ 且 $m(E_1) < \infty$, 则 $m\left(\bigcap_{k=1}^{\infty} E_k\right) = \lim_{k \rightarrow \infty} m(E_k)$.

【证】我们将使用可测集的Carathéodory 定义(即条件(C)).

(a): 我们在可测集的两个定义的等价性的证明中已证明了每个开集满足Carathéodory 条件(C). 所以开集是可测集。

(b): 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 且 $m^*(E) = 0$, 则对任意 $T \subset \mathbb{R}^d$ 有 $m^*(T \cap E) \leq m^*(E) = 0$ 从而有

$$m^*(T) \geq m^*(T \cap E^c) = m^*(T \cap E) + m^*(T \cap E^c) \geq m^*(T)$$

即 $m^*(T) = m^*(T \cap E) + m^*(T \cap E^c)$, 所以 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.

(c): 由 $(E^c)^c = E$ 可知Carathéodory 条件(C)中 E 与 E^c 的地位是对称的. 因此有 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d) \iff E^c \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.

(d): 先证明若 $A, B \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 且 $A \cap B = \emptyset$, 则有 $A \cup B \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.

考虑“不交并”分解(此处给出文图):

$$\mathbb{R}^d = (A \cup B) \cup (A \cup B)^c,$$

$$A \cup B = [A \cap B] \cup [A \cap B^c] \cup [A^c \cap B].$$

由此, 对任意 $T \subset \mathbb{R}^d$ 有

$$T = [T \cap (A \cup B)] \cup [T \cap (A \cup B)^c],$$

$$T \cap (A \cup B) = [T \cap A \cap B] \cup [T \cap A \cap B^c] \cup [T \cap A^c \cap B],$$

$$T \cap (A \cup B)^c = T \cap A^c \cap B^c.$$

由次可加性和 $A, B \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 有

$$m^*(T \cap (A \cup B)) + m^*(T \cap (A \cup B)^c)$$

$$\begin{aligned}
&\leq m^*(T \cap A \cap B) + m^*(T \cap A \cap B^c) \\
&+ m^*(T \cap A^c \cap B) + m^*(T \cap A^c \cap B^c) \\
&= m^*(T \cap A) + m^*(T \cap A^c) = m^*(T) \quad \forall T \subset \mathbb{R}^d.
\end{aligned}$$

这蕴含 $A \cup B$ 满足条件(C). 因此 $A \cup B \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.

注意, 由(c)还知 $(A \cup B)^c \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 这是一个一般结论。于是我们相继得到 $A \cap B = [A^c \cup B^c]^c \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $A \setminus B = A \cap B^c \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 这个性质将在下面用到。

由 $\bigcup_{k=1}^n E_k = (\bigcup_{k=1}^{n-1} E_k) \cup E_n$ 和归纳法易证: 若 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $k = 1, 2, \dots, n$, 则 $\bigcup_{k=1}^n E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.

推广到可数并: 首先说明, 如果给定的可测集只有有限多个: E_1, E_2, \dots, E_n , 那么补充空集, 即令 $E_k = \emptyset$, $k = n+1, n+2, n+3, \dots$, 则有

$$\bigcup_{k=1}^n E_k = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k \quad \text{且} \quad \sum_{k=1}^n m(E_k) = \sum_{k=1}^{\infty} m(E_k).$$

并且若 E_1, E_2, \dots, E_n 互不相交, 则 E_1, E_2, E_3, \dots 也互不相交。因此不失一般性我们可以只考虑有可数无限多个 E_k 的情形。

设 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $k = 1, 2, 3, \dots$. 先假设 E_k 互不相交. 令 $S_n = \bigcup_{k=1}^n E_k$. 来证明对任意 $T \subset \mathbb{R}^d$ 有

$$m^*(T \cap S_n) = \sum_{k=1}^n m^*(T \cap E_k), \quad n = 1, 2, \dots \quad (1.4.3)$$

当 $n = 1$ 时(1.4.3) 成立. 假设(1.4.3)对于 n 成立, 则对于 $n+1$, 由 $E_{n+1} \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 和 $S_{n+1} \cap (E_{n+1})^c = S_n$ 有

$$\begin{aligned}
m^*(T \cap S_{n+1}) &= m^*(T \cap S_{n+1} \cap E_{n+1}) + m^*(T \cap S_{n+1} \cap (E_{n+1})^c) \\
&= m^*(T \cap E_{n+1}) + m^*(T \cap S_n) = \sum_{k=1}^{n+1} m^*(T \cap E_k).
\end{aligned}$$

据归纳法原理知(1.4.3)对任意 $n \in \mathbb{N}$ 成立.

令 $S = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k$. 则由(1.4.3) 和 $S_n \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 得到

$$\begin{aligned}
m^*(T) &= m^*(T \cap S_n) + m^*(T \cap (S_n)^c) = \sum_{k=1}^n m^*(T \cap E_k) + m^*(T \cap (S_n)^c) \\
&\geq \sum_{k=1}^n m^*(T \cap E_k) + m^*(T \cap S^c) \quad (\text{因为 } (S_n)^c \supset S^c).
\end{aligned}$$

令 $n \rightarrow \infty$, 则每一项 $m^*(T \cap E_k)$ 都被加进来了:

$$\begin{aligned} m^*(T) &\geq \sum_{k=1}^{\infty} m^*(T \cap E_k) + m^*(T \cap S^c) \\ &\geq m^*\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} T \cap E_k\right) + m^*(T \cap S^c) = m^*(T \cap S) + m^*(T \cap S^c) \geq m^*(T). \end{aligned}$$

以上用到了次可加性. 因此 $\forall T \subset \mathbb{R}^d$ 有

$$m^*(T) = \sum_{k=1}^{\infty} m^*(T \cap E_k) + m^*(T \cap S^c) = m^*(T \cap S) + m^*(T \cap S^c).$$

这证明了 $S \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 即 $S = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 同时取 $T = S$, 我们还证明了 m^* 在 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 上具有可数可加性(因 $S \cap S^c = \emptyset$ 且 $m^*(\emptyset) = 0$), 即

$$m^*\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k\right) = \sum_{k=1}^{\infty} m^*(E_k).$$

其次转到一般情形: E_k 不必互不相交. 如前面作法, 令

$$\tilde{E}_1 = E_1, \quad \tilde{E}_2 = E_2 \setminus E_1, \quad \tilde{E}_k = E_k \setminus \bigcup_{j=1}^{k-1} E_j, \quad k = 2, 3, \dots$$

则 $\tilde{E}_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ ($k = 1, 2, \dots$) 且

$$\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k = \bigcup_{k=1}^{\infty} \tilde{E}_k, \quad \tilde{E}_i \cap \tilde{E}_j = \emptyset, \quad i \neq j.$$

因此 $\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k = \bigcup_{k=1}^{\infty} \tilde{E}_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.

(e): 这是外测度的次可加性的特殊情形: 每个 E_k 是可测集. 此时有 $m^*(E_k) = m(E_k)$.

(f): 将(c),(d)中的结果用于两个可测集: 设 $A, B \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 则由 $A^c, B^c \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 知 $A^c \cup B^c \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 从而有 $A \cap B = (A^c \cup B^c)^c \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $A \setminus B = A \cap B^c \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 于是由 $A \cup B = A \cup (B \setminus A)$ 和可加性有

$$m(A \cup B) = m(A) + m(B \setminus A).$$

同时由 $B = (B \setminus A) \cup (A \cap B)$ 有

$$m(B) = m(B \setminus A) + m(A \cap B).$$

因此当 $m(A \cap B) < \infty$ 时有

$$m(B \setminus A) = m(B) - m(A \cap B)$$

从而有

$$m(A \cup B) = m(A) + m(B) - m(A \cap B).$$

(g): 先设 E_k 单调增加: $E_1 \subset E_2 \subset E_3 \subset \dots$. 为证明极限等式, 可以假定对所有 k 都有 $m(E_k) < \infty$ (否则由单调性知极限等式两边都等于 $+\infty$). 这时我们对可加性公式可以做减法运算:

$$m(E_k \setminus E_{k-1}) = m(E_k) - m(E_{k-1}), \quad k = 1, 2, 3, \dots; \quad E_0 := \emptyset.$$

另一方面由 E_k 单调增加我们有“不交并”分解:

$$\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k = \bigcup_{k=1}^{\infty} (E_k \setminus E_{k-1}).$$

根据可数可加性和正项级数的定义得到

$$\begin{aligned} m\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k\right) &= \sum_{k=1}^{\infty} m(E_k \setminus E_{k-1}) = \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{k=1}^n m(E_k \setminus E_{k-1}) \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{k=1}^n \left(m(E_k) - m(E_{k-1})\right) = \lim_{n \rightarrow \infty} \left(m(E_n) - m(E_0)\right) \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} m(E_n). \quad (\text{因 } E_0 = \emptyset) \end{aligned}$$

最后设 E_k 单调下降: $E_1 \supset E_2 \supset E_3 \supset \dots$, 并设 $m(E_1) < \infty$. 则有

$$E_1 \setminus E_2 \subset E_1 \setminus E_3 \subset E_1 \setminus E_4 \subset \dots; \quad E_1 \setminus \bigcap_{k=1}^{\infty} E_k = \bigcup_{k=1}^{\infty} (E_1 \setminus E_k).$$

因此

$$m\left(E_1 \setminus \bigcap_{k=1}^{\infty} E_k\right) = \lim_{k \rightarrow \infty} m(E_1 \setminus E_k).$$

注意 $m(E_k) \leq m(E_1) < \infty$, 这就给出

$$m(E_1) - m\left(\bigcap_{k=1}^{\infty} E_k\right) = m(E_1) - \lim_{k \rightarrow \infty} m(E_k).$$

注意 $m(E_1) < \infty$, 消去 $m(E_1)$ 即得极限等式. \square

这就完成了定理的证明. \square

【命题1.4.9(互不重叠的可加性)】 设 E_1, E_2, E_3, \dots 为 \mathbb{R}^d 中互不重叠的可测集, 其中互不重叠是指

$$\text{当 } i \neq j \text{ 时 } m(E_i \cap E_j) = 0.$$

则成立可加性:

$$m\left(\bigcup_{k \geq 1} E_k\right) = \sum_{k \geq 1} m(E_k).$$

【证】 令

$$Z = \bigcup_{i,j \geq 1, i \neq j} E_i \cap E_j.$$

则

$$m(Z) \leq \sum_{i,j \geq 1, i \neq j} m(E_i \cap E_j) = 0.$$

即 Z 是零测集. 易见 $E_1 \setminus Z, E_2 \setminus Z, E_3 \setminus Z, \dots$ 互不相交且

$$\bigcup_{k \geq 1} E_k = Z \cup \bigcup_{k \geq 1} (E_k \setminus Z).$$

于是由 $m(Z) = 0$ 和可加性得到

$$m\left(\bigcup_{k \geq 1} E_k\right) = m\left(\bigcup_{k \geq 1} (E_k \setminus Z)\right) = \sum_{k \geq 1} m(E_k \setminus Z) = \sum_{k \geq 1} m(E_k). \quad \square$$

【例】 设 I_1, I_2, I_3, \dots 是 \mathbb{R}^d 中的有界区间且内部互不相交, 即 $I_i^\circ \cap I_j^\circ = \emptyset$ for all $i \neq j$. 则 I_1, I_2, I_3, \dots 互不重叠从而成立可加性

$$m\left(\bigcup_{k \geq 1} I_k\right) = \sum_{k \geq 1} m(I_k) = \sum_{k \geq 1} |I_k|.$$

事实上当 $i \neq j$ 时有 $I_i \cap I_j \subset \partial I_i \cup \partial I_j$. 由前面例题知 $m(\partial I_i) = m(\partial I_j) = 0$, 因此 $m(I_i \cap I_j) = 0$. 所以 I_1, I_2, I_3, \dots 互不重叠。 \square

【定义(σ -代数、可测集与可测空间)】 设 X 是一个集合, \mathcal{A} 是 X 的一个子集族, 即 \mathcal{A} 是由 X 的一些子集组成的集合族。如果 \mathcal{A} 具有下列性质

(i) $X \in \mathcal{A}$

(ii) 补集封闭: 若 $E \in \mathcal{A}$, 则补集 $E^c := X \setminus E \in \mathcal{A}$

(iii) 可数并封闭: 若 $E_k \in \mathcal{A}, k = 1, 2, \dots$, 则 $\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k \in \mathcal{A}$

则称 \mathcal{A} 为 X 上的一个 σ -代数, 并称 (X, \mathcal{A}) 为一个可测空间, \mathcal{A} 中的元素称为可测集。 \square

从这个定义我们容易得到

【定义的推论】

(1) 空集 $\emptyset = (\mathbb{R}^d)^c \in \mathcal{A}$.

(2) 有限并封闭: 若 $E_k \in \mathcal{A}$, $k = 1, 2, \dots, n$, 则 $\bigcup_{k=1}^n E_k \in \mathcal{A}$.

事实上在(iii)中取 $E_{n+1} = E_{n+2} = \dots = \emptyset$, 则 $\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k = \bigcup_{k=1}^n E_k \in \mathcal{A}$.

(3) 可数交封闭: 若 $E_k \in \mathcal{A}$, $k = 1, 2, \dots$, 则 $\bigcap_{k=1}^{\infty} E_k = (\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k^c)^c \in \mathcal{A}$.

(4) 有限交封闭: 若 $E_k \in \mathcal{A}$, $k = 1, 2, \dots, n$, 则 $\bigcap_{k=1}^n E_k = (\bigcup_{k=1}^n E_k^c)^c \in \mathcal{A}$;

(5) 差集封闭: 若 $E_1, E_2 \in \mathcal{A}$, 则 $E_1 \setminus E_2 = E_1 \cap E_2^c \in \mathcal{A}$. \square

这些性质说明 σ -代数 \mathcal{A} 就是这样一个集合类: \mathcal{A} 中有限多个或可数多个元素经过有限次或可数次集合运算——交、并、差、补——所得结果仍在 \mathcal{A} 中.

【注1】 如果在可测集定义中把“可数并封闭”换为“有限并封闭”则相应的 \mathcal{A} 称为 X 上的一个代数.

【注2】 “ σ -代数”的前缀 σ 是求和符号 Σ 的小写(早年间, Σ 也表示求并), 在这里用于提示可数并: $\sigma = \bigcup_{k=1}^{\infty}$. “可数并封闭”意味着容纳了更多的可测集; 而相应的可数可加性也为很多收敛问题的研究奠定了宽阔稳定的基础.

【注3】 σ -代数的存在性: 令 2^X 是由 X 的所有子集组成的集合族. 则显然 2^X 是 X 上的一个 σ -代数并且是 X 上的最大的 σ -代数, 即 X 上的任何 σ -代数都是 2^X 的子集. 而两个元素的集合 $\{X, \emptyset\}$ 也是 X 的一个 σ -代数, 它是 X 上的最小的 σ -代数, 即 X 上的任何 σ -代数都包含 $\{X, \emptyset\}$. 但这两个极端的 σ -代数用处不大. 通常我们需要这样的 σ -代数: 它是包含了我们感兴趣的 X 的某类子集族的最小的 σ -代数. 例如对于 $X = \mathbb{R}^d$ 的情形, \mathbb{R}^d 上最常用的 σ -代数是 Borel σ -代数, 它是由 \mathbb{R}^d 中所有开集生成的 σ -代数, 具体见下面.

【由给定的集合族生成的 σ -代数】

从测度和积分角度看, 可测空间过大就可能产生较多的奇异现象. 下面的命题告诉我们如何使可测空间不过大且好包含了我们感兴趣的集合类. 这就是所谓“最小”或“生成”的概念:

【命题1.4.9】 设 \mathcal{G} 是 X 的一个子集族, 令 $\sum(\mathcal{G})$ 是 X 上的所有包含 \mathcal{G} 的 σ -代数的全体. 则交集

$$\mathcal{B} = \bigcap_{\mathcal{A} \in \sum(\mathcal{G})} \mathcal{A}$$

仍是 X 上的一个 σ -代数且 $\mathcal{B} \supset \mathcal{G}$, 即 $\mathcal{B} \in \sum(\mathcal{G})$ 。换言之, \mathcal{B} 是 X 上包含 \mathcal{G} 的最小 σ -代数。我们也称 \mathcal{B} 是 X 上的由 \mathcal{G} 生成的 σ -代数。

【证】因对任意 $\mathcal{A} \in \sum(\mathcal{G})$ 都有 $\mathcal{A} \supset \mathcal{G}$, 故也有 $\mathcal{B} \supset \mathcal{G}$ 。下面验证 \mathcal{B} 满足 σ -代数的三个规定性质。

(i) 对任意 $\mathcal{A} \in \sum(\mathcal{G})$, 因 \mathcal{A} 是 \mathbb{R}^d 上的 σ -代数, 故 $\mathbb{R}^d \in \mathcal{A}$ 。因此 $\mathbb{R}^d \in \bigcap_{\mathcal{A} \in \sum(\mathcal{G})} \mathcal{A} = \mathcal{B}$ 。

(ii) 设 $E \in \mathcal{B}$ 。则对任意 $\mathcal{A} \in \sum(\mathcal{G})$ 有 $E \in \mathcal{A}$ 。因 \mathcal{A} 是 σ -代数, 故 $E^c \in \mathcal{A}$ 。因此 $E^c \in \bigcap_{\mathcal{A} \in \sum(\mathcal{G})} \mathcal{A} = \mathcal{B}$ 。

(iii) 设 $E_k \in \mathcal{B}, k = 1, 2, 3, \dots$ 。则对任意 $\mathcal{A} \in \sum(\mathcal{G})$ 有 $E_k \in \mathcal{A}, k = 1, 2, 3, \dots$ 。因 \mathcal{A} 是 σ -代数, 故 $\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k \in \mathcal{A}$ 。因此 $\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k \in \bigcap_{\mathcal{A} \in \sum(\mathcal{G})} \mathcal{A} = \mathcal{B}$ 。

这证明了 \mathcal{B} 是 X 上的 σ -代数。 \square

下面我们只考虑 $X = \mathbb{R}^d$ 的情形。

\mathbb{R}^d 上最常用的 σ -代数是所谓Borel σ -代数, 它是由 \mathbb{R}^d 的开集族生成的 σ -代数。

【定义(Borel σ -代数和Borel集)】设 \mathcal{G} 为 \mathbb{R}^d 的开集的全体, $\mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$ 是 \mathbb{R}^d 上由 \mathcal{G} 生成的 σ -代数。则称 $\mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$ 是 \mathbb{R}^d 上的Borel σ -代数, 并称 $\mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$ 中的元素称为Borel集。 \square

由 σ -代数的定义和Borel集的定义立刻得知:

\mathbb{R}^d 中的所有开集, 闭集都是Borel集, 并且由开集, 闭集经过可数次集合运算(交、并、差、补)所得到的集合也都是Borel集。

两个常用的Borel集类: G_δ -型集和 F_σ -型集。

G_δ -型集: $E \subset \mathbb{R}^d$ 称为是一个 G_δ -型集如果 E 可以表示成可数多个开集的交。

F_σ -型集: $E \subset \mathbb{R}^d$ 称为是一个 F_σ -型集如果 E 可以表示成可数多个闭集的并。

由此定义和DeMorgen对偶律可知, 集合 E 是一个 G_δ -型集当且仅当其补集 E^c 是一个 F_σ -型集。

【例】 \mathbb{R}^d 中每个开集都是 F_σ -型集且可表示成一系列递增的紧集的并。具体来说, 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为任一开集。若 $\Omega = \mathbb{R}^d$ 或 $\Omega = \emptyset$, 则结论是显然的。设 $\emptyset \neq \Omega \neq \mathbb{R}^d$ 。此时有

$$\Omega = \{x \in \mathbb{R}^d \mid \text{dist}(x, \Omega^c) > 0\}.$$

据此我们考虑集合

$$K_n = \{x \in \mathbb{R}^d \mid \text{dist}(x, \Omega^c) \geq \frac{1}{n}, |x| \leq n\}, \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

易见 K_n 是紧集且

$$K_1 \subset K_2 \subset K_3 \subset \dots; \quad \Omega = \bigcup_{n=1}^{\infty} K_n. \quad \square$$

【命题1.4.10】 (a) \mathbb{R}^d 中的Lebesgue 可测集的全体 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 是 \mathbb{R}^d 上的一个 σ -代数并且 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^d) \supset \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$, 即 \mathbb{R}^d 中的Borel 集都是Lebesgue 可测集。

(b) (可测集的正则性) 若 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 则对任意 $\varepsilon > 0$ 存在开集 $\Omega \supset E$ 和闭集 $F \subset E$ 使得 $m(\Omega \setminus E) < \varepsilon, m(E \setminus F) < \varepsilon$.

(c) (可测集的结构) 若 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 则存在一个 G_δ -型集 $H \supset E$ 和一个零测集 Z 使得 $E = H \setminus Z$, 同时存在一个 F_σ -型集 $F \subset E$ 和另一个零测集 Z 使得 $E = F \cup Z$.

进一步, 这个 G_δ -型集 H 可以表示成一系列递降的开集的交:

$$H = \bigcap_{j=1}^{\infty} G_j, \quad G_j \text{ 是开集且 } G_1 \supset G_2 \supset G_3 \supset \dots$$

同时这个 F_σ -型集 F 可以表示成一系列递增的紧集的并:

$$F = \bigcup_{j=1}^{\infty} K_j, \quad K_j \text{ 是紧集且 } K_1 \subset K_2 \subset K_3 \subset \dots$$

【证】 (a): 这是定理1.4.8(Lebesgue可测集和测度的基本性质)、 σ -代数的定义和Borel集的定义的直接推论。

(b): 上述开集 \mathcal{O} 的存在是可测集的定义(回忆 L -可测集的两个等价定义). 由于 $E^c = \mathbb{R}^d \setminus E$ 也是可测集, 故存在 $\mathcal{O} \supset E^c$ 使得 $m(\mathcal{O} \setminus E^c) < \varepsilon$. 令 $F = \mathcal{O}^c$, 则 F 是开集且 $F \subset E$. 于是有 $E \setminus F = E \cap F^c = F^c \cap E = \mathcal{O} \cap (E^c)^c = \mathcal{O} \setminus E^c$, 所以 $m(E \setminus F) = m(\mathcal{O} \setminus E^c) < \varepsilon$.

(c): 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 则对每个 $k \in \mathbb{N}$, 存在开集 $\mathcal{O}_k \supset E$ 使得 $m(\mathcal{O}_k \setminus E) < \frac{1}{k}$. 令

$$H = \bigcap_{k=1}^{\infty} \mathcal{O}_k, \quad Z = H \setminus E$$

则 H 是一个 G_δ -型集且 $H \supset E$ 且 $E = H \setminus Z$ 并有

$$m(Z) = m\left(\bigcap_{k=1}^{\infty} \mathcal{O}_k \setminus E\right) \leq m(\mathcal{O}_n \setminus E) < \frac{1}{n} \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty).$$

因此 $m(Z) = 0$. 令

$$G_j = \bigcap_{k=1}^j \mathcal{O}_k, \quad j = 1, 2, 3, \dots$$

则 G_j 是开集(有限多个开集的交是开集) 且

$$G_1 \supset G_2 \supset G_3 \supset \dots, \quad H = \bigcap_{j=1}^{\infty} G_j.$$

将这一结果应用于 $E^c = \mathbb{R}^d \setminus E$, 则存在开集列 $\mathcal{O}_k \supset E^c$ 和零测集 Z 使得

$$E^c = \left(\bigcap_{k=1}^{\infty} \mathcal{O}_k \right) \setminus Z = \left(\bigcap_{k=1}^{\infty} \mathcal{O}_k \right) \cap Z^c.$$

取补集并令 $F_k = \mathcal{O}_k^c$, $F = \bigcup_{k=1}^{\infty} F_k$, 得到

$$E = (E^c)^c = \left(\left(\bigcap_{k=1}^{\infty} \mathcal{O}_k \right) \cap Z^c \right)^c = \left(\bigcap_{k=1}^{\infty} \mathcal{O}_k \right)^c \cup Z = \left(\bigcup_{k=1}^{\infty} F_k \right) \cup Z = F \cup Z.$$

将 F_k 写成可数个紧集的并: $F_k = \bigcup_{n=1}^{\infty} F_k \cap [-n, n]^d$. 则有

$$F = \bigcup_{k \geq 1} \bigcup_{n=1}^{\infty} F_k \cap [-n, n]^d.$$

令

$$K_j = \bigcup_{k \geq 1, n \geq 1, k+n \leq j+1} F_k \cap [-n, n]^d, \quad j = 1, 2, 3, \dots$$

则每个 K_j 是紧集(有限多个紧集的并是紧集) 且有

$$K_1 \subset K_2 \subset K_3 \subset \dots, \quad F = \bigcup_{j=1}^{\infty} K_j. \quad \square$$

作业题(2018.3.7)

1. 自学上面讲义, 有些内容课上没时间讲, 但后面常用。
2. 周民强《实变函数论》(2001年版, 北大出版社)P85: 1, 2, 3; P94: 1, 4 ; P100: 1, 3.
3. Stein 和Shakarchi 的《实分析》第1章第6节习题5, 11 (周书里有类似题解法), 14, 16 (其中注意记号 $\limsup_{k \rightarrow \infty} E_k = \bigcap_{n=1}^{\infty} \bigcup_{k=n}^{\infty} E_k$), 25, 26, 27, 28; 第7节习题5.

周民强的书因各版页码可能不同, 故将上面留的题目抄录如下:

周书P85: 1,2,3 解答下列问题:

1. 设 $A \subset \mathbb{R}^d$ 且 $m^*(A) = 0$, 试证明对任意 $B \subset \mathbb{R}^d$ 有

$$m^*(A \cup B) = m^*(B) = m^*(B \setminus A).$$

(换言之, 对 B 加上或减去一个零测集, 不改变 B 的外测度。)

2. (i) 设 $A, B \subset \mathbb{R}^d$ 且 $m^*(A) < \infty, m^*(B) < \infty$, 试证明

$$|m^*(A) - m^*(B)| \leq m^*(A \Delta B)$$

这里和下面,

$$A \Delta B = (A \setminus B) \cup (B \setminus A), \quad \text{称之为 } A, B \text{ 的对称差.}$$

(ii) 设 $A, B, C \subset \mathbb{R}^d$ 且有

$$m^*(A \Delta B) = 0, \quad m^*(B \Delta C) = 0.$$

证明 $m^*(A \Delta C) = 0$.

3. 设 $E \subset \mathbb{R}^d$. 若对任意 $x \in E$, 存在开球 $B(x, \delta_x)$ 使得 $m^*(E \cap B(x, \delta_x)) = 0$, 试证明 $m^*(E) = 0$. [可数覆盖]

周书P94: 1, 4 解答下列问题:

1. 设 $E \subset [0, 1]^d$. 试证明

若 $m^*(E) = 1$, 则 $\bar{E} = [0, 1]^d$. 若 $m^*(E) = 0$, 则 $E^\circ = \emptyset$.

这里 \bar{E}, E° 分别表示 E 的闭包和内部。

4. 设 $B \subset \mathbb{R}^d$ 满足对任意 $\varepsilon > 0$ 存在可测集 $A \subset \mathbb{R}^d$ 使得 $m^*(A \Delta B) < \varepsilon$, 证明 B 是可测集。

周书P100: 1, 3 解答下列问题:

1. 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 且 $m^*(E) < \infty$. 若有

$$m^*(E) = \sup\{m(K) \mid K \text{ 是紧集且 } K \subset E\}.$$

试证明 E 是可测集。

3. 设 $A, B \subset \mathbb{R}^d$. 试证明

$$m^*(A \cup B) + m^*(A \cap B) \leq m^*(A) + m^*(B).$$

[建议先证明集合的等测包的存在性: 对于任一集合 $E \subset \mathbb{R}^d$, 由外测度的定义和性质易见存在一系列开集 $\mathcal{O}_n \supset E, n = 1, 2, 3, \dots$ 使得集合 $H = \bigcap_{n=1}^{\infty} \mathcal{O}_n$ 满足 $m(H) = m^*(E)$. 称这样的 H 为 E 的一个等测包.]

§1.5. 连续变换下集合的可测性和测度估计

问题: 连续映射是否把可测集映为可测集?

举例(见周民强实变函数论中的关于Cantor 三分集): Cantor 集 C :

$$C = \{x \in [0, 1] \mid x = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{a_k}{3^k}, a_k \in \{0, 2\}\}.$$

[注: 对于 $2 \leq p \in \mathbb{N}$, 今后在小数的 p -进制表示

$$x = 0.a_1a_2a_3 \cdots = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{a_k}{p^k}, \quad a_k \in \{0, 1, \dots, p-1\}$$

中, 对于 p -进有理数只取0出现最多的那种表示, 即例如

对于两种表示 $x = 0.00(p-1)(p-1)(p-1) \cdots = 0.0p000 \cdots$, 取第二种表示.

在这个约定下, 小数的 p -进制表示中的 a_k 就是唯一的。]

周知 C 是零测集。令

$$\varphi(x) = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{2} \frac{a_k}{2^k} \quad \text{if} \quad x = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{a_k}{3^k} \in C.$$

将 φ 延拓到 $[0, 1]$ 上:

$$\Phi(x) = \sup_{C \ni y \leq x} \varphi(y), \quad x \in [0, 1].$$

则 Φ 在 $[0, 1]$ 上单调不减且连续, 其中连续性是因为 $\Phi([0, 1]) = [0, 1]$. 这个 Φ 称为 $[0, 1]$ 上的Cantor 函数. (给出几何图像.) 由于 $\Phi(C) = \varphi(C) = [0, 1]$, 而 $m(C) = 0$, 故这说明 Φ 把某个零测集映为正测度集合. 这就蕴含 Φ 把一些可测集映成了不可测集(见下面引理)。

【引理1.5.1】 设 E_0 为 L -可测集(即 $E_0 \in \mathcal{M} = \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$), $\varphi: E_0 \rightarrow \mathbb{R}^d$ 连续. 则

φ 把 E_0 中的 L -可测集映为 L -可测集 $\iff \varphi$ 把 E_0 中的 L -零测集映为 L -零测集。

【证】 “ \implies ” : 设 φ 把 E_0 中的 L -可测集映为 L -可测集. 设 $Z \subset E_0$ 为 L -零测集. 因 L -零测集是 L -可测集, 故 $\varphi(Z)$ 是 L -可测集. 若 $m(\varphi(Z)) > 0$, 则由后面讲的关于不可测集的存在性结果知 $\varphi(Z)$ 含有一个不可测集 W . 令

$$Z_0 = \{x \in Z \mid \varphi(x) \in W\}$$

则易见 $\varphi(Z_0) = W$. 因 L -零测集的子集还是 L -零测集从而是 L -可测集, 因此 Z_0 是 L -可测集(含于 E_0 中). 这就与假设矛盾. 因此必须有 $m(\varphi(Z)) = 0$.

“ \Leftarrow ”：设 φ 把 E_0 中的 L -零测集映为 L -零测集。任取可测集 $E \subset E_0$ ，由可测集的结构定理(命题1.4.10)知存在紧集列 $K_j (j = 1, 2, 3, \dots)$ 和零测集 Z 使得

$$E = Z \cup \bigcup_{j=1}^{\infty} K_j. \quad \text{这给出} \quad \varphi(E) = \varphi(Z) \cup \bigcup_{j=1}^{\infty} \varphi(K_j).$$

因 φ 连续而 K_j 是紧集，故 $\varphi(K_j)$ 是紧集。又 Z 是零测集，故由假设知 $\varphi(Z)$ 是零测集从而是可测集。所以 $\varphi(E)$ 是可测集。 \square

下面命题说明，如果映射是Lipschitz 连续的(即满足局部或整体Lipschitz条件)，则这映射就把可测集映为可测集。

【定理1.5.2】 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集，映射 $\varphi : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 。假设 φ 属于 C^1 类，或更一般些，假设 φ 满足局部Lipschitz条件(即对任意 $x_0 \in \Omega$ ，存在 $\delta > 0$ 和 $0 < L < \infty$ 使得 $B(x_0, \delta) \subset \Omega$ 且 $|\varphi(x) - \varphi(y)| \leq L|x - y|$ for all $x, y \in B(x_0, \delta)$)。则 φ 把 Ω 中的零测集映为零测集，从而把 Ω 中的可测集映为可测集。

【证】 设 φ 在 Ω 内满足局部Lipschitz条件。由引理1.5.1，只需证明 φ 把 Ω 中的零测集映为零测集。据定理1.2.2(开集的方体分解)，存在可数个互不重叠的闭方体 I_j 使得 $\Omega = \bigcup_{j=1}^{\infty} I_j$ 。设 $Z \subset \Omega$ 是一个零测集。则有 $Z = \bigcup_{j=1}^{\infty} I_j \cap Z$,

$$\varphi(Z) = \bigcup_{j=1}^{\infty} \varphi(I_j \cap Z), \quad m^*(\varphi(Z)) \leq \sum_{j=1}^{\infty} m^*(\varphi(I_j \cap Z)).$$

为证 $m^*(\varphi(Z)) = 0$ 只需证明对每个 j 都有 $m^*(\varphi(I_j \cap Z)) = 0$ 。任取 $j \in \mathbb{N}$ ，为记号简便，记 $I := I_j$ 。因 I 是 Ω 中的紧集，故由数学分析知 φ 在 I 上满足Lipschitz条件，即存在 $0 < L < \infty$ 使得

$$|\varphi(x) - \varphi(y)| \leq L|x - y| \quad \forall x, y \in I.$$

来证明 $m^*(\varphi(I \cap Z)) = 0$ 。以 $I \cap Z$ 代替 Z 可设 $Z \subset I$ 。于是只需证明 $m^*(\varphi(Z)) = 0$ 。因 $m(Z) = 0$ ，故对任意 $\varepsilon > 0$ 存在开集 $\mathcal{O} \supset Z$ 使得 $m(\mathcal{O}) < \varepsilon$ 。对 \mathcal{O} ，再由定理1.2.2(开集的方体分解)，存在可数个互不重叠的闭方体 Q_k 使得 $\mathcal{O} = \bigcup_{k=1}^{\infty} Q_k$ 。这给出

$$\begin{aligned} Z &= \bigcup_{k=1}^{\infty} Z \cap Q_k, \quad \varphi(Z) = \bigcup_{k=1}^{\infty} \varphi(Z \cap Q_k), \\ m^*(\varphi(Z)) &\leq \sum_{k=1}^{\infty} m^*(\varphi(Z \cap Q_k)). \end{aligned} \tag{1.5.1}$$

来证明

$$m^*(\varphi(Z \cap Q_k)) \leq Cm(Q_k), \quad k = 1, 2, 3, \dots \quad (1.5.2)$$

其中 $C = (2L\sqrt{d})^d$. 固定 $k \in \mathbb{N}$, 为证(1.5.2), 可设 $Z \cap Q_k \neq \emptyset$. 取 $a_k \in Z \cap Q_k$, 令 $l_k = l(Q_k)$ 为 Q_k 的棱长. 写 $\varphi(x) = (\varphi_1(x), \varphi_2(x), \dots, \varphi_d(x))$, 则对任意 $x \in Z \cap Q_k$ 有

$$|\varphi_i(x) - \varphi_i(a_k)| \leq |\varphi(x) - \varphi(a_k)| \leq L|x - a_k| \leq L\text{diam}(Q_k) = L\sqrt{d}l_k, \quad i = 1, 2, \dots, d;$$

$$\implies \varphi_i(x) \in [\varphi_i(a_k) - L\sqrt{d}l_k, \varphi_i(a_k) + L\sqrt{d}l_k], \quad i = 1, 2, \dots, d;$$

$$\implies \varphi(x) \in \prod_{i=1}^d [\varphi_i(a_k) - L\sqrt{d}l_k, \varphi_i(a_k) + L\sqrt{d}l_k] =: \tilde{Q}_k$$

$$\implies \varphi(Z \cap Q_k) \subset \tilde{Q}_k$$

$$\implies m^*(\varphi(Z \cap Q_k)) \leq m(\tilde{Q}_k) = (2L\sqrt{d}l_k)^d = C(l_k)^d = Cm(Q_k).$$

这证明了(1.5.2)成立. 由(1.5.1), (1.5.2) 得到

$$m^*(\varphi(Z)) \leq C \sum_{k=1}^{\infty} m(Q_k) = Cm(\mathcal{O}) < C\varepsilon.$$

由 $\varepsilon > 0$ 的任意性即知 $m^*(\varphi(Z)) = 0$. 所以 $\varphi(Z)$ 是 L -零测集. \square

下面学习平移, 展缩, 和一般线性变换下 Lebesgue 测度的计算公式.

回忆记号: 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为任一集合. 对任意 $h \in \mathbb{R}^d, \lambda \in \mathbb{R}$ 和方阵 $A \in \mathbb{R}^{d \times d}$, 我们定义

$$E \text{ 的平移: } \quad E + h = h + E = \{x + h \mid x \in E\},$$

$$E \text{ 的展缩: } \quad \lambda E = \{\lambda x \mid x \in E\},$$

$$E \text{ 的反射: } \quad -E = (-1)E = \{-x \mid x \in E\},$$

$$E \text{ 的一般线性变换: } \quad A(E) = \{Ax \mid x \in E\}.$$

综合情形

$$E \text{ 的一般仿线性变换: } \quad \lambda A(E) + h = \{\lambda Ax + h \mid x \in E\}.$$

【注】按数学表达的约定, 当向量右乘矩阵时, 这向量是列向量.

【定理1.5.3(平移和线性变换下Lebesgue测度的计算公式)】

设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为 L -可测集。则有

(a) 平移不变性:

$$m(E + h) = m(E) \quad \forall h \in \mathbb{R}^d.$$

(b) 展缩变换:

$$m(\lambda E) = |\lambda|^d m(E) \quad \forall \lambda \in \mathbb{R}.$$

(c) 一般线性变换:

$$m(A(E)) = |\det A| m(E) \quad \forall A \in \mathbb{R}^{d \times d}.$$

一般地, 对任一集合 $E \subset \mathbb{R}^d$, 把 m 换成外测度 m^* , 上述等式仍成立。

【注】上面用到广义实数乘法的约定 $0 \cdot \infty = 0$. 当 $\lambda = 0, m(E) = \infty$ 时或者当 $\det A = 0, m(E) = \infty$ 时, 有

$$|\lambda|^d m(E) = 0 \cdot \infty = 0, \quad |\det A| m(E) = 0 \cdot \infty = 0.$$

【定理的证明】首先由 $x \mapsto \lambda x + h, x \mapsto Ax$ 是 \mathbb{R}^d 到 \mathbb{R}^d 的光滑映射和**定理1.5.2** 知它们把零测集映为零测集从而把可测集映为可测集. 定理的证明分为几步.

Step 1. 证明(a),(b). 一般地我们证明(a),(b) 对于任一集合的外测度也成立, 即对任意 $E \subset \mathbb{R}^d, h \in \mathbb{R}^d$ 和 $\lambda \in \mathbb{R}$ 有

$$m^*(\lambda E + h) = |\lambda|^d m^*(E) \quad \forall E \subset \mathbb{R}^d. \quad (1.5.3)$$

首先回忆, 当 $\lambda \neq 0$ 时, 区间的平移和展缩还是区间: 设 I 是一个 d 维有界区间, 例如设 $I = \prod_{i=1}^d [a_i, b_i)$ 是左闭右开的. 则对任意 $h = (h_1, h_2, \dots, h_d) \in \mathbb{R}^d$ 和任意 $\lambda \in \mathbb{R} \setminus \{0\}$ 有

$$\begin{aligned} \lambda I + h &= \prod_{i=1}^d [\lambda a_i + h_i, \lambda b_i + h_i) & \text{if } \lambda > 0, \\ \lambda I + h &= \prod_{i=1}^d (\lambda b_i + h_i, \lambda a_i + h_i] & \text{if } \lambda < 0. \end{aligned}$$

若 $\lambda = 0$, 则 $\lambda E + h = \{h\}$ 是单点集因而是 L -零测集. 此时(1.5.3) 成立.

设 $\lambda \neq 0$, $\{I_k\}_{k \geq 1}$ 是 E 的任意有界区间覆盖: $E \subset \bigcup_{k \geq 1} I_k$. 则 $\lambda E + h \subset \bigcup_{k \geq 1} (\lambda I_k + h)$. 因 $\lambda I_k + h$ 也是有界区间且 $|\lambda I_k + h| = |\lambda|^d |I_k|$, 故

$$m^*(\lambda E + h) \leq \sum_{k \geq 1} |\lambda I_k + h| = |\lambda|^d \sum_{k \geq 1} |I_k|.$$

这给出

$$\frac{1}{|\lambda|^d} m^*(\lambda E + h) \leq \sum_{k \geq 1} |I_k|.$$

由 $\{I_k\}_{k \geq 1}$ 的任意性知

$$\frac{1}{|\lambda|^d} m^*(\lambda E + h) \leq m^*(E) \quad \text{即} \quad m^*(\lambda E + h) \leq |\lambda|^d m^*(E).$$

将这个一般不等式应用于

$$E = \lambda^{-1}(\lambda E + h) - \lambda^{-1}h$$

有

$$m^*(E) \leq |\lambda^{-1}|^d m^*(\lambda E + h) = \frac{1}{|\lambda|^d} m^*(\lambda E + h)$$

即

$$|\lambda|^d m^*(E) \leq m^*(\lambda E + h).$$

所以(1.5.3) 成立.

Step 2. 对于任意矩阵 $A \in \mathbb{R}^{d \times d}$ 令

$$\Delta(A) = m(A([0, 1]^d)).$$

来证明当 A 可逆时

$$m(A(E)) = \Delta(A)m(E) \quad \forall E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d). \quad (1.5.4)$$

先证明等式(1.5.4) 对于任何左闭右开的方体 Q 成立. 写 $Q = \prod_{i=1}^d [h_i, h_i + \lambda)$, $\lambda > 0$.

由集合的平移、展缩的定义和 $x \mapsto Ax$ 是线性变换, 易见

$$Q = [0, \lambda)^d + h = \lambda[0, 1)^d + h, \quad A(Q) = \lambda A([0, 1)^d) + Ah.$$

因此由(1.5.3) 和 $m(Q) = \lambda^d$ 有

$$m(A(Q)) = \lambda^d m(A([0, 1]^d)) = \Delta(A)m(Q).$$

其次证明(1.5.4) 对任意开集成立. 任取开集 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$, 根据定理1.2.2(开集的方体分解) 可表 $\Omega = \bigcup_{k=1}^{\infty} Q_k$, 其中 Q_k 是互不相交的左闭右开的2-进方体. 注意 $x \mapsto Ax$ 是单射(因A可逆), 故 $A(Q_k)$ 也互不相交. 于是由 $A(\Omega) = \bigcup_{k=1}^{\infty} A(Q_k)$ 有

$$m(A(\Omega)) = \sum_{k=1}^{\infty} m(A(Q_k)) = \Delta(A) \sum_{k=1}^{\infty} m(Q_k) = \Delta(A)m(\Omega).$$

利用这一结果来证明(1.5.4) 对任意紧集成立. 任取紧集 $K \subset \mathbb{R}^d$. 取一个有界开集 $\Omega \supset K$. 则有 $K = \Omega \setminus (\Omega \setminus K)$. 因 $\Omega \setminus K$ 也是开集, 故由开集的结果和 $A(K) = A(\Omega) \setminus A(\Omega \setminus K)$ 有(注意这些集合皆有界因而测度有限)

$$m(A(K)) = m(A(\Omega)) - m(A(\Omega \setminus K)) = \Delta(A) \left(m(\Omega) - m(\Omega \setminus K) \right) = \Delta(A)m(K).$$

最后对任意 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 由Lebesgue可测集的结构定理(命题1.4.10), 存在一列递增的紧集 $K_1 \subset K_2 \subset K_3 \subset \dots$ 和一零测集 Z 使得 $E = \bigcup_{j=1}^{\infty} K_j \cup Z$. 因

$$A(E) = \bigcup_{j=1}^{\infty} A(K_j) \cup A(Z), \quad A(K_1) \subset A(K_2) \subset A(K_3) \subset \dots, \quad \text{且 } A(Z) \text{ 也是 } L\text{-零测集}$$

故由上面结果和测度的单调极限定理得到

$$\begin{aligned} m(A(E)) &= m\left(\bigcup_{j=1}^{\infty} A(K_j)\right) = \lim_{j \rightarrow \infty} m(A(K_j)) = \Delta(A) \lim_{j \rightarrow \infty} m(K_j) \\ &= \Delta(A)m\left(\bigcup_{j=1}^{\infty} K_j\right) = \Delta(A)m(E). \end{aligned}$$

Step 3. 证明对任意可逆矩阵 $A, B \in \mathbb{R}^{d \times d}$ 有

$$\Delta(AB) = \Delta(A)\Delta(B). \quad (1.5.5)$$

事实上有 $\Delta(\cdot)$ 的定义并在恒等式(1.5.4) 中取 $E = B([0, 1]^d)$ 便有

$$\Delta(AB) = m(AB([0, 1]^d)) = \Delta(A)m(B([0, 1]^d)) = \Delta(A)\Delta(B).$$

Step 4. 证明

$$\Delta(A) = |\det A| \quad \forall A \in \mathbb{R}^{d \times d}. \quad (1.5.6)$$

当 $A = \text{diag}\{\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_d\}$ 为正对角阵时($\lambda_i > 0, i = 1, 2, \dots, d$), 易见 $A([0, 1]^d) = \prod_{i=1}^d [0, \lambda_i]$ 从而

$$\Delta(A) = m(A([0, 1]^d)) = m\left(\prod_{i=1}^d [0, \lambda_i]\right) = \left| \prod_{i=1}^d [0, \lambda_i] \right| = \prod_{i=1}^d \lambda_i = \det A \quad (> 0).$$

当A 为正交阵时, 取 $E = \{x \in \mathbb{R}^d \mid |x| \leq 1\}$ (单位球), 则由 $|Ax| \equiv |x|$ 知 $A(E) = E$ 且显然 $0 < m(E) < \infty$. 于是由(1.5.4) 得到 $\Delta(A) = 1 = |\det A|$.

设A 为一般可逆阵. 由线代数知对于正定阵 $A^T A$, 存在正交阵T 使得 $T^{-1} A^T A T = D^2$ 为对角阵, 其中 $D = \text{diag}\{\sqrt{\lambda_1}, \sqrt{\lambda_2}, \dots, \sqrt{\lambda_d}\}$, $\lambda_i > 0, i = 1, 2, \dots, d$. 令 $T_1 = A T D^{-1}$. 则 T_1 是正交阵且 $T_1 D = A T$, $|\det A|$. 因D 是正对角阵, 故如上

$$\Delta(D) = \prod_{i=1}^d \sqrt{\lambda_i} = \det D = |\det A|.$$

因 $\Delta(T) = \Delta(T_1) = 1$, 故应用公式(1.5.5) 即得

$$\Delta(A) = \Delta(AT) = \Delta(T_1 D) = \Delta(D) = |\det A|.$$

最后设A 不可逆, 即 $\det A = 0$. 此时为证 $\Delta(A) = 0$, 我们直接证明最大集合 $A(\mathbb{R}^d)$ 为L-零测集, 也即证明

$$\text{当 } \det A = 0 \text{ 时, } m(A(\mathbb{R}^d)) = 0. \quad (1.5.7)$$

当 $\text{rank}(A) = 0$ 时(它等价于 $A = 0$), 上式显然成立. 设 $\text{rank}(A) = r \in \{1, 2, \dots, d-1\}$. 则由线性代数, 存在可逆方阵P, Q 使得

$$A = P D Q, \quad D = \text{diag}\{1, \dots, 1, 0, \dots, 0\} \text{ (对角阵)}.$$

由P, Q 可逆有

$$Q(\mathbb{R}^d) = \mathbb{R}^d, \quad A(\mathbb{R}^d) = P D(\mathbb{R}^d), \quad m(A(\mathbb{R}^d)) = |\det P| m(D(\mathbb{R}^d)).$$

故为证(1.5.7), 只需证明 $m(D(\mathbb{R}^d)) = 0$. 考虑分解

$$\mathbb{R}^d = \bigcup_{k=1}^{\infty} [-k, k]^d, \quad D(\mathbb{R}^d) = \bigcup_{k=1}^{\infty} D([-k, k]^d).$$

我们有

$$D([-k, k]^d) = [-k, k]^r \times \{(0, \dots, 0)\}, \quad m(D([-k, k]^d)) = 0, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

因此由测度的次可加性即得 $m(D(\mathbb{R}^d)) = 0$. 所以(1.5.7)成立.

这就对可测集完成了线性变换公式(c)的证明。

最后证明对任意集合 $E \subset \mathbb{R}^d$, 线性变换公式(c)对于外测度 m^* 也成立。任取 $E \subset \mathbb{R}^d, A \in \mathbb{R}^{d \times d}$. 若 $\det A = 0$, 则由(1.5.6)有

$$m^*(A(E)) \leq m^*(A(\mathbb{R}^d)) = m(A(\mathbb{R}^d)) = 0, \quad \text{因此} \quad m^*(A(E)) = 0 = |\det A| m^*(E).$$

设 $\det A \neq 0$. 对每个 $j \in \mathbb{N}$ 选取 E 的区间覆盖 $\{I_{k,j}\}_{k \geq 1}$ 使得 $\sum_{k \geq 1} |I_{k,j}| \leq m^*(E) + 1/j$. 令 $G_j = \bigcup_{k \geq 1} I_{k,j}$. 则 G_j 是 L -可测集且 $G_j \supset E$,

$$m^*(E) \leq m(G_j) \leq \sum_{k \geq 1} m(I_{k,j}) = \sum_{k \geq 1} |I_{k,j}| \leq m^*(E) + 1/j \rightarrow m^*(E) \quad (j \rightarrow \infty)$$

因此

$$\lim_{j \rightarrow \infty} m(G_j) = m^*(E).$$

于是由 $A(E) \subset A(G_j)$ 得到

$$m^*(A(E)) \leq m(A(G_j)) = |\det A| m(G_j) \rightarrow |\det A| m^*(E) \quad (j \rightarrow \infty).$$

因此

$$m^*(A(E)) \leq |\det A| m^*(E).$$

将这一不等式应用于 A^{-1} 和 $A(E)$ 有

$$m^*(E) = m^*(A^{-1}(A(E))) \leq |\det(A^{-1})| m^*(A(E)) = \frac{1}{|\det A|} m^*(A(E)).$$

因此反向不等式也成立:

$$|\det A| m^*(E) \leq m^*(A(E)).$$

所以等式 $m^*(A(E)) = |\det A| m^*(E)$ 成立。定理证毕。 \square

有了一般线性变换公式, 现在可以完成

【命题1.4.7(Lebesgue零测集的基本性质)之(d)的证明】

设 $d \geq 2$, $X \subset \mathbb{R}^d$ 是 \mathbb{R}^d 的线性子空间且 $\dim(X) < d$. 则存在 $A \in \mathbb{R}^{d \times d}$ 使得 $X = A(\mathbb{R}^d)$ 且 $\det A = 0$. 对任意 $h \in \mathbb{R}^d$, 由平移不变性和 $\det A = 0$ 有

$$m(X + h) = m(X) = m(A(\mathbb{R}^d)) = |\det A| m(\mathbb{R}^d) = 0 \cdot \infty = 0. \quad \square$$

【注】上面用到了约定: $0 \cdot \infty = 0$. 如果不习惯这种证明, 则可考虑下面的证明, 它顺便解释了为什么约定 $0 \cdot \infty = 0$ 是合理的. 事实上如果考虑有限区间 $I_k = [-k, k]^d$ 就可避免出现 $0 \cdot \infty$: 由线性变换公式有

$$m(A(I_k)) = |\det A| m(I_k) = 0 \cdot m(I_k) = 0, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

因 $A(\mathbb{R}^d) = \bigcup_{k=1}^{\infty} A(I_k)$, 故 $A(\mathbb{R}^d)$ 是可数个零测的并, 所以 $A(\mathbb{R}^d)$ 是 L -零测集. 这里的关键是: 0 是绝对常数 0, 而不是不定型极限中变化着的无穷小! 其它类似现象都可以按此解释.

§1.6. 不可测集的存在性

不可测集的存在性的证明一定是非构造性的, 或者是抽象“构造”的, 因为至少直观上看, 任何具体造出的集合都是 Borel 集合从而是可测集. 不可测集的抽象“构造”依靠选择公理, 所以我们先回忆选择公理.

【选择公理】 设 $\{X\}$ 是由一些(有限多个或无限多个)互不相交的非空集合 X 组成的集合族. 则存在一个子集 $C \subset \bigcup X$ 使得对每个 X , 交集 $C \cap X = \{x\}$ 是单点集, 这个单点集中的元素 x 称为它所在集合 X 的代表元, 而代表元的集合 C 称为代表团. \square

注意, 在选择公理的这个表述中, “互不相交”是重要条件, 不能去掉, 否则容易造出反例. 此外注意, 对任意一个非空集合 X , 将这个选择公理用于这个集合 X 上, 则这个选择公理是说, 即便无法给出或无法描述选取元素的方法, 仍可以从 X 中取出一个元素来做事情.

注意在这个选择公理中, 所考虑的集合族中的集合是没有编号(没有下标的), 这是因为在某些情况下, 对集合编号是很难实现的.

但是若所考虑的集合族中的集合是可编号的(有下标的), 则应用上述选择公理我们可以得到另一版本的选择公理, 其中不要求集合之间“互不相交”, 从而更加体现了“选择”的作用!

【命题(选择公理的另一版本)】 设 $\{X_\alpha\}_{\alpha \in A}$ 是由一些非空集合组成的集合族. 则存在一个选择映射 $\varphi: A \rightarrow \bigcup_{\alpha \in A} X_\alpha$ 使得对任意 $\alpha \in A$ 有 $\varphi(\alpha) \in X_\alpha$.

[于是 $x_\alpha := \varphi(\alpha)$ 即为 X_α 的代表元, $C := \{x_\alpha \mid \alpha \in A\}$ 即为代表团.]

【证】 令

$$\tilde{X}_\alpha = \{(x, \alpha) \mid x \in X_\alpha\}, \quad \alpha \in A.$$

则易见 \tilde{X}_α 互不相交: 当 $\alpha, \beta \in A$ 且 $\alpha \neq \beta$ 时, $\tilde{X}_\alpha \cap \tilde{X}_\beta = \emptyset$. 将上述选择公理用于集合族 $\{\tilde{X}_\alpha\}_{\alpha \in A}$, 则存在一个子集 $\tilde{C} \subset \bigcup_{\alpha \in A} \tilde{X}_\alpha$ 使得对每个 $\alpha \in A$, 交集 $\tilde{C} \cap \tilde{X}_\alpha = \{(\alpha, x_\alpha)\}$ 是单点集. 定义映射 $\varphi: A \rightarrow \bigcup_{\alpha \in A} X_\alpha$ 如下: 对任意 $\alpha \in A$, 定义 $\varphi(\alpha) = x_\alpha$. 要证明这个 φ 是个映射(也即 φ 是被良好定义的), 也即须且只需证明当 $\alpha = \beta \in$

A 时 $\varphi(\alpha) = \varphi(\beta)$. 事实上若 $\alpha = \beta \in A$, 则 $\tilde{X}_\alpha = \tilde{X}_\beta$ 从而有 $\tilde{C} \cap \tilde{X}_\alpha = \tilde{C} \cap \tilde{X}_\beta$. 这蕴含 $(\alpha, x_\alpha) = (\beta, x_\beta)$. 因此 $x_\alpha = x_\beta$ 所以 $\varphi(\alpha) = x_\alpha = x_\beta = \varphi(\beta)$. \square

【命题1.6.1(不可测集的存在性)】 \mathbb{R}^d 中每个 L -测度大于零的 L -可测集都含有一个 L -不可测集. 因此若一个 L -可测集的每个子集都是 L -可测集, 则此集合必是 L -零测集.

【证(by Sierpinski)】 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为 L -可测集且 $m(E) > 0$. 来证明 E 含有一个 L -不可测集. 由测度的单调极限性质有

$$m(E) = \lim_{k \rightarrow +\infty} m(E \cap [-k, k]^d).$$

因此存在 $R \in \mathbb{N}$ 使得 $m(E \cap [-R, R]^d) > 0$. 所以不失一般性我们可以假定 $E \subset [-R, R]^d$ 且 $m(E) > 0$.

我们对 E 中的点做等价分类:

$$\text{对任意 } x, y \in E, \text{ 定义 } x \sim y \iff x - y \in \mathbb{Q}^d.$$

由有理点集 \mathbb{Q}^d 关于向量加减法运算封闭易见“ \sim ” 确是 E 上的一个等价关系, 即下面三个规定性质成立:

$$x \sim x; \quad x \sim y \implies y \sim x; \quad x \sim y \text{ 且 } y \sim z \implies x \sim z. \quad (x, y, z \in E)$$

设 $[x]$ 为 E 中的点 x 所属的等价类, 即 $[x] = \{z \in E \mid z \sim x\}$. 由等价关系的定义我们有

$$[x] \cap [y] \neq \emptyset \iff x \sim y \iff [x] = [y]. \text{ 也即 } [x] \cap [y] = \emptyset \iff [x] \neq [y].$$

设 $\{[x]\}$ 是 E 中所有互不相同的等价类的全体. 因为这些等价类互不相交, 据选择公理, 存在集合 $W \subset \bigcup [x]$ 使得 W 与每个等价类 $[x]$ 的交集 $W \cap [x]$ 为单点集, 换言之 W 是由从每个等价类中取出一个代表元组成的代表团. 设 $\{r_k\}_{k=1}^\infty = \mathbb{Q}^d \cap [-2R, 2R]^d$, 其中 r_k 互不相同. 令 $W_k = W + r_k$ (平移). 来证明

$$W_k \text{ 互不相交且 } E \subset \bigcup_{k=1}^\infty W_k \subset [-3R, 3R]^d.$$

假设存在 $k \neq j$ 使 $W_k \cap W_j \neq \emptyset$. 取 $x \in W_k \cap W_j$, 则存在 $x_k, x_j \in W$ 使得 $x = x_k + r_k = x_j + r_j$ 从而 $x_k \sim x_j$, $[x_k] = [x_j]$. 于是 $x_k, x_j \in W \cap [x_j] \implies x_k = x_j \implies r_k = r_j \implies k = j$. 矛盾. 所以 W_k 互不相交. 对任意 $x \in E \implies W \cap [x] = \{y\}$ (单点集) $\implies x \sim y \implies x - y \in \mathbb{Q}^d$. 因 $x, y \in E \subset [-R, R]^d \implies x - y \in [-2R, 2R]^d$ 故 $x - y \in \mathbb{Q}^d \cap [-2R, 2R]^d$. 于是存在 $k \in \mathbb{N}$ 使得 $x - y = r_k$. 所以 $x = y + r_k \in W + r_k = W_k$. 这证

明了 $E \subset \bigcup_{k=1}^{\infty} W_k$. 又由 $W \subset E \subset [-R, R]^d$ 和 $r_k \in [-2R, 2R]^d$ 有 $W + r_k \subset [-3R, 3R]^d$, 因此一切 $W_k = W + r_k \subset [-3R, 3R]^d$, 即 $\bigcup_{k=1}^{\infty} W_k \subset [-3R, 3R]^d$.

由上面证明的包含关系得到

$$0 < m(E) = m^*(E) \leq m^*\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} W_k\right) \leq m^*([-3R, 3R]^d) = m([-3R, 3R]^d) < \infty.$$

同时由外测度的次可加性和平移不变性 $m^*(W_k) = m^*(W)$ 有

$$0 < m^*\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} W_k\right) \leq \sum_{k=1}^{\infty} m^*(W_k) = m^*(W) + m^*(W) + m^*(W) + \cdots.$$

这蕴涵 $m^*(W) > 0$ 于是上式右端 $= +\infty$. 但 $m^*(\bigcup_{k=1}^{\infty} W_k) < \infty$, 这就给出外测度次可加的严格不等式:

$$m^*\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} W_k\right) < \sum_{k=1}^{\infty} m^*(W_k). \quad (1.6.1)$$

由这个严格的次可加不等式易见 W (代表团) 不是可测集. 否则, W 是可测集 \implies 平移 $W_k = W + r_k$ 是可测集 ($k = 1, 2, 3, \dots$). 因 W_k 互不相交, 故由可测集类的可数可加性知不等式(1.6.1) 应该是等式, 矛盾. 所以 W 不是可测集. 因 $W \subset E$, 这就证明了 E 含有一个不可测集. \square

作业题(2018.3.14)

- 周民强《实变函数论》(第2版2008年, 北大出版社) P102 思考题1, P110 第一组2,3,4,5,6,8,9,14; 第二组1,4,5,9 (其中第9题也是Stein 和Shakarchi 的《实分析第1章第7节的习题1).
- Stein和Shakarchi的《实分析》第1章第6节习题 11 (周书中有类似解法), 13(a).

作业题(2018.3.16)

- 周民强《实变函数论》(第2版2008年, 北大出版社) P102 思考题1, P110 第一组中的15,16; 第二组中的8,13.
- Stein和Shakarchi的《实分析》第1章第6节习题 6,7.

§1.7. Vitali 覆盖引理

本节学习Vitali 覆盖引理, 它是研究集合的性质、函数局部性质以及Hausdorff 测度与积分等等的有力工具。【数学教科书中, 带人名的定理、引理都是好用的有力的工具!】

【强调】除非特别说明, 我们总要求开球、闭球的半径大于零, 开方体、闭方体的棱长大于零, 且它们是有界的, 也即总是指非退化的直径有限的球体和方体。

【定义(Vitali 覆盖)】设 $E \subset \mathbb{R}^d$. 若 \mathcal{V} 是由 \mathbb{R}^d 中的一些(可以是不可数多个)闭球或闭方体组成的集合族, 满足: 对任意 $x \in E$ 和任意 $\varepsilon > 0$, 存在 $B \in \mathcal{V}$ 使得 $x \in B$ 且 $\text{diam}(B) < \varepsilon$, 则称 \mathcal{V} 是 E 的一个Vitali 覆盖. \square

【例】(1) 设 $E \subset \mathbb{R}^n$, $\mathcal{V} = \{\prod_{i=1}^d [x_i, x_i + \delta] \mid x = (x_1, x_2, \dots, x_d) \in E, 0 < \delta \leq 1\}$. 则 \mathcal{V} 是 E 的一个Vitali 覆盖. 这是因为 \mathcal{V} 中闭方体的直径 $\sqrt{d}\delta \in (0, \sqrt{d}]$ 可以任意小。

(2) 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集. 则对任意 $\delta > 0$, 闭球族 $\mathcal{V} = \{\overline{B}(x, r) \mid 0 < r \leq \delta, \overline{B}(x, r) \subset \Omega\}$. 都是 Ω 的一个Vitali 覆盖. 事实上对任意 $x \in \Omega$, 对任意 $\varepsilon > 0$, 因 Ω 是开集, 故存在 $0 < r < \min\{\delta, \varepsilon/2\}$ 使得 $\overline{B}(x, r) \subset \Omega$. 由 $r < \delta$ 知 $\overline{B}(x, r) \in \mathcal{V}$, 而由 $\text{diam}(\overline{B}(x, r)) = 2r < \varepsilon$ 知 \mathcal{V} 是 Ω 的一个Vitali 覆盖. \square

【保持中心不动的展缩】设 B 为一个有界闭球和有界闭方体, $a = (a_1, a_2, \dots, a_d)$ 是它的中心, 即

$$B = \overline{B}(a, r) \quad \text{或} \quad B = \prod_{i=1}^d \left[a_i - \frac{l}{2}, a_i + \frac{l}{2} \right].$$

用平移和展缩, 二者也可写成

$$B = r\mathbb{B}^d + a \quad \text{或} \quad B = l \left[-\frac{1}{2}, \frac{1}{2} \right]^d + a.$$

这里 $\mathbb{B}^d = \{x \in \mathbb{R}^d \mid |x| \leq 1\}$ 是闭单位球。

对任意 $\lambda > 0$, 令 λB 表示与 B 有相同的中心、直径扩大或缩小了 λ 倍的同类集合, 即

$$\lambda B = \overline{B}(a, \lambda r) = \lambda r \mathbb{B}^d + a \quad \text{或} \quad \lambda B = \prod_{i=1}^d \left[a_i - \frac{\lambda l}{2}, a_i + \frac{\lambda l}{2} \right] = \lambda l \left[-\frac{1}{2}, \frac{1}{2} \right]^d + a.$$

此时易见有

$$\text{diam}(\lambda B) = \lambda \text{diam}(B), \quad m(\lambda B) = \lambda^d m(B), \quad m(B) = C_d [\text{diam}(B)]^d$$

其中 $C_d = 2^{-d} m(\mathbb{B}^d)$ 当 B 是闭球时; $C_d = (1/\sqrt{d})^d$ 当 B 是闭方体时。

【Vitali覆盖引理】 设 $E \subset \mathbb{R}^d$, \mathcal{V} 是 E 的一个 Vitali 覆盖。则存在可数子集 $\{B_k\}_{k \in \mathbb{N}_0} \subset \mathcal{V}$, 其中 B_k 互不相交, $\mathbb{N}_0 = \{1, 2, \dots, N\}$ ($N \in \mathbb{N}$) 或 $\mathbb{N}_0 = \mathbb{N}$, 使得

$$m^*\left(E \setminus \bigcup_{k \in \mathbb{N}_0} B_k\right) = 0.$$

【证】 (I) 先设 $E \subset \Omega$ 其中 Ω 是一有界开集。此时我们证明 Vitali 覆盖引理中的成员 $B_k \in \mathcal{V}$ 还可以都含于 Ω 内。证明分为三步:

Step 1. 公共准备。若 $F \subset \mathbb{R}^d$ 为闭集, $x \in \mathbb{R}^d \setminus F$, $B \in \mathcal{V}$, 满足 $x \in B$ 且 $\text{diam}(B) < \text{dist}(x, F)$, 则必有 $B \cap F = \emptyset$ 。

这是因为若 $B \cap F \neq \emptyset$, 则取一点 $y \in B \cap F$ 便得到矛盾:

$$\text{dist}(x, F) \leq |x - y| \leq \text{diam}(B) < \text{dist}(x, F).$$

Step 2. 令 $\tilde{\mathcal{V}} = \{B \in \mathcal{V} \mid B \subset \Omega\}$ 。则 $\tilde{\mathcal{V}}$ 也是 E 的 Vitali 覆盖。事实上, 对任意 $x \in E$ 和任意 $\varepsilon > 0$, 因 Ω 是包含 E 的开集, 故有 $x \in \Omega$ 从而有 $\text{dist}(x, \Omega^c) > 0$ 。而由 \mathcal{V} 是 E 的 Vitali 覆盖知存在 $B \in \mathcal{V}$ 使得 $x \in B$ 且 $\text{diam}(B) < \min\{\varepsilon, \text{dist}(x, \Omega^c)\}$ 。由 **Step 1** 知这蕴含 $B \cap \Omega^c = \emptyset$, 即 $B \subset \Omega$, 因此 $B \in \tilde{\mathcal{V}}$ 且 $\text{diam}(B) < \varepsilon$ 。所以 $\tilde{\mathcal{V}}$ 也是 E 的 Vitali 覆盖。

如果存在 $N \in \mathbb{N}$ 和 $\tilde{\mathcal{V}}$ 中 N 个互不相交的集合 B_1, B_2, \dots, B_N 使得 $E \setminus \bigcup_{k=1}^N B_k = \emptyset$, 则 (I) 的证明已完成。以下假设对任意 $n \in \mathbb{N}$ 和 $\tilde{\mathcal{V}}$ 中任何 n 个互不相交的集合 B_1, B_2, \dots, B_n 都有

$$E \setminus \bigcup_{k=1}^n B_k \neq \emptyset.$$

我们将用归纳操作程序证明 Vitali 覆盖引理。

第1步: 取定一个 $B_1 \in \tilde{\mathcal{V}}$ 。因 $E \setminus B_1 \neq \emptyset$, 故取一点 $x_0 \in E \setminus B_1$ 。由 B_1 是闭集知 $\text{dist}(x_0, B_1) > 0$, 因此存在 $B \in \tilde{\mathcal{V}}$ 使得 $x_0 \in B$ 且 $\text{diam}(B) < \text{dist}(x_0, B_1)$ 。由 **Step 1** 知这蕴含 $B \cap B_1 = \emptyset$ 。这表明集合 $\{B \in \tilde{\mathcal{V}} \mid B \cap B_1 = \emptyset\}$ 非空。令

$$d_1 = \sup_{B \in \tilde{\mathcal{V}}, B \cap B_1 = \emptyset} \text{diam}(B).$$

则存在 $B_2 \in \tilde{\mathcal{V}}$ 使得

$$B_2 \cap B_1 = \emptyset, \quad \text{diam}(B_2) > \frac{d_1}{2}.$$

第2步: 因 $E \setminus (B_1 \cup B_2) \neq \emptyset$, 故取一点 $x_0 \in E \setminus (B_1 \cup B_2)$ 。由 $B_1 \cup B_2$ 是闭集知 $\text{dist}(x_0, B_1 \cup B_2) > 0$ 因此存在 $B \in \tilde{\mathcal{V}}$ 使得 $x_0 \in B$ 且 $\text{diam}(B) < \text{dist}(x_0, B_1 \cup B_2)$ 。

由**Step 1**知这蕴含 $B \cap (B_1 \cup B_2) = \emptyset$. 这表明集合 $\{B \in \tilde{\mathcal{V}} \mid B \cap (B_1 \cup B_2) = \emptyset\}$ 非空令

$$d_2 = \sup_{B \in \tilde{\mathcal{V}}, B \cap (B_1 \cup B_2) = \emptyset} \text{diam}(B).$$

则存在 $B_3 \in \tilde{\mathcal{V}}$ 使得

$$B_3 \cap (B_1 \cup B_2) = \emptyset, \quad d(B_3) > \frac{d_2}{2}.$$

假设在第 n 步得到了 $\tilde{\mathcal{V}}$ 中的互不相交的集合 B_1, B_2, \dots, B_{n+1} 满足

$\{B \in \tilde{\mathcal{V}} \mid B \cap \bigcup_{j=1}^k B_j = \emptyset\}$ 非空,

$$\text{diam}(B_{k+1}) > \frac{1}{2}d_k, \quad d_k = \sup_{B \in \tilde{\mathcal{V}}, B \cap \bigcup_{j=1}^k B_j = \emptyset} \text{diam}(B) \quad (1.7.1)$$

$k = 1, 2, \dots, n$. 则在第 $n+1$ 步, 由 $E \setminus \bigcup_{k=1}^{n+1} B_k \neq \emptyset$, 可取一点 $x_0 \in E \setminus \bigcup_{k=1}^{n+1} B_k$. 由 $\bigcup_{k=1}^{n+1} B_k$ 是闭集知 $\text{dist}(x_0, \bigcup_{k=1}^{n+1} B_k) > 0$, 因此存在 $B \in \tilde{\mathcal{V}}$ 使得 $x_0 \in B$ 且 $\text{diam}(B) < \text{dist}(x_0, \bigcup_{k=1}^{n+1} B_k)$. 由**Step 1**知这蕴含 $B \cap \bigcup_{k=1}^{n+1} B_k = \emptyset$. 这表明 $\{B \in \tilde{\mathcal{V}} \mid B \cap \bigcup_{j=1}^{n+1} B_j = \emptyset\}$ 非空. 于是对于

$$d_{n+1} = \sup_{B \in \tilde{\mathcal{V}}, B \cap \bigcup_{k=1}^{n+1} B_k = \emptyset} \text{diam}(B)$$

存在 $B_{n+2} \in \tilde{\mathcal{V}}$ 使得

$$B_{n+2} \cap \bigcup_{k=1}^{n+1} B_k = \emptyset, \quad \text{diam}(B_{n+2}) > \frac{d_{n+1}}{2}.$$

由归纳操作原理知以上手续对每个自然数 n 均可施行, 从而得到 $\tilde{\mathcal{V}}$ 中的互不相交的集合列 $\{B_k\}_{k=1}^{\infty}$ 和正数列 $\{d_k\}_{k=1}^{\infty}$, 它们具有上述性质.

下面证明 $m^*(E \setminus \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k) = 0$. 首先由 $B_k \subset \Omega$ 和 B_k 互不相交有

$$\sum_{k=1}^{\infty} m(B_k) = m\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} B_k\right) \leq m(\Omega) < \infty. \quad (1.7.2)$$

这蕴含 $\lim_{k \rightarrow \infty} m(B_k) = 0$. 令 $\underline{C}_d = \min\{2^{-d}m(\mathbb{B}^d), (1/\sqrt{d})^d\}$. 则有

$$m(B_k) \geq \underline{C}_d [\text{diam}(B_k)]^d. \quad \text{因此} \quad \lim_{k \rightarrow \infty} \text{diam}(B_k) = 0.$$

令 $\lambda = 5\sqrt{d}$ 并令 λB_k 表示与 B_k 有相同的中心、直径扩大了 λ 倍的同类集合. 来证明

$$E \setminus \bigcup_{k=1}^n B_k \subset \bigcup_{k=n+1}^{\infty} \lambda B_k, \quad n = 1, 2, 3, \dots \quad (1.7.3)$$

对任意 $n \in \mathbb{N}$ 和任意 $x \in E \setminus \bigcup_{k=1}^n B_k$, 因 $\bigcup_{k=1}^n B_k$ 是闭集, 故 $\text{dist}(x, \bigcup_{k=1}^n B_k) > 0$, 因此存在 $B \in \tilde{\mathcal{V}}$ 使得 $x \in B$ 且 $|B| < \text{dist}(x, \bigcup_{k=1}^n B_k)$. 由 **Step 1** 知这蕴含 $B \cap \bigcup_{k=1}^n B_k = \emptyset$. 易见

集合 $\{k \in \mathbb{N} \mid k \geq n+1, B \cap B_k \neq \emptyset\}$ 非空.

否则, 这集合为空集, 则由 $B \cap \bigcup_{k=1}^n B_k = \emptyset$ 有 $B \cap B_k = \emptyset$ for all $k = 1, 2, 3, \dots$. 于是由 d_k 的定义以及 $\text{diam}(B_{k+1})$ 与 d_k 的关系(1.7.1) 有

$$\text{diam}(B_{k+1}) > \frac{1}{2}d_k \geq \frac{1}{2}\text{diam}(B) \quad \text{for all } k = 1, 2, 3, \dots$$

这与 $\lim_{k \rightarrow \infty} \text{diam}(B_k) = 0$ 矛盾. 令

$$j = \min\{k \in \mathbb{N} \mid k \geq n+1, B \cap B_k \neq \emptyset\}.$$

则 $j \geq n+1$, $B \cap B_j \neq \emptyset$ 且 $B \cap \bigcup_{k=1}^{j-1} B_k = \emptyset$. 这蕴含

$$\text{diam}(B) \leq d_{j-1} < 2\text{diam}(B_j).$$

设 $a_j = (a_{j1}, a_{j2}, \dots, a_{jd})$ 为 B_j 的中心. 则借助一点 $y \in B \cap B_j$ 我们有 (注意 $x \in B$)

$$|x - a_j| \leq |x - y| + |y - a_j| \leq \text{diam}(B) + \frac{1}{2}\text{diam}(B_j) \leq \frac{5}{2}\text{diam}(B_j).$$

若 $B_j = \overline{B}(a_j, r_j)$ 是闭球, 则 $\frac{5}{2}\text{diam}(B_j) = 5r_j$ 从而有 $x \in \overline{B}(a_j, 5r_j) = 5\overline{B}(a_j, r_j) = 5B_j \subset \lambda B_j$. 若 $B_j = \prod_{i=1}^d [a_{ji} - \frac{1}{2}l_j, a_{ji} + \frac{1}{2}l_j]$ 是闭方体, 则 $\frac{5}{2}\text{diam}(B_j) = 5\sqrt{d}\frac{1}{2}l_j = \lambda\frac{1}{2}l_j$ 从而有 $x \in \prod_{i=1}^d [a_{ji} - \lambda\frac{1}{2}l_j, a_{ji} + \lambda\frac{1}{2}l_j] = \lambda B_j$. 总之有 $x \in \lambda B_j$. 于是再由 $j \geq n+1$ 知 $x \in \bigcup_{k=n+1}^{\infty} \lambda B_k$. 所以(1.7.3) 成立.

最后由(1.7.3) 有

$$E \setminus \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k \subset E \setminus \bigcup_{k=1}^n B_k \subset \bigcup_{k=n+1}^{\infty} \lambda B_k, \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

于是结合 $m(\lambda B_k) = \lambda^d m(B_k)$ 和收敛性(1.7.2) 得到

$$m^*\left(E \setminus \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k\right) \leq \sum_{k=n+1}^{\infty} m(\lambda B_k) = \lambda^d \sum_{k=n+1}^{\infty} m(B_k) \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty).$$

所以 $m^*(E \setminus \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k) = 0$.

(II) 对一般情形, 令 $E_{\mathbf{p}} = E \cap Q_{\mathbf{p}}$ 其中 $Q_{\mathbf{p}} = \prod_{i=1}^d (p_i, p_i + 1)$ 是开方体, $\mathbf{p} = (p_1, p_2, \dots, p_d) \in \mathbb{Z}^d$. 因闭方体 $\overline{Q}_{\mathbf{p}}$ 的全体覆盖了 \mathbb{R}^d 而 $Q_{\mathbf{p}}$ 的边界是零测集, 故

$$E = Z \cup \bigcup_{\mathbf{p} \in \mathbb{Z}_0^d} E_{\mathbf{p}} \quad \text{其中 } Z \text{ 是零测集, } \mathbb{Z}_0^d = \{\mathbf{p} \in \mathbb{Z}^d \mid E_{\mathbf{p}} \neq \emptyset\}.$$

由Vitali 覆盖的定义知 \mathcal{V} 也是 E 的子集 $E_{\mathbf{p}}$ 的Vitali覆盖。因 $E_{\mathbf{p}} \subset Q_{\mathbf{p}}$ 且 $Q_{\mathbf{p}}$ 是有界开集, 故由(I)的结果知存在可数子集 $\{B_{\mathbf{p},k}\}_{k \in \mathbb{N}_{\mathbf{p}}} \subset \mathcal{V}$, 其中 $B_{\mathbf{p},k}$ 互不相交且均含于 $Q_{\mathbf{p}}$ 内, 使得差集 $E_{\mathbf{p}} \setminus \bigcup_{k \in \mathbb{N}_{\mathbf{p}}} B_{\mathbf{p},k}$ 是零测集。这蕴含

$$E \setminus \bigcup_{\mathbf{p} \in \mathbb{Z}_0^d, k \in \mathbb{N}_{\mathbf{p}}} B_{\mathbf{p},k} \subset Z \cup \bigcup_{\mathbf{p} \in \mathbb{Z}_0^d} \left(E_{\mathbf{p}} \setminus \bigcup_{k \in \mathbb{N}_{\mathbf{p}}} B_{\mathbf{p},k} \right) \text{ 是零测集.}$$

由于 $Q_{\mathbf{p}}$ 互不相交, 故 $B_{\mathbf{p},k}$ 也互不相交, 即当 $\mathbf{p} \neq \mathbf{q}$ 时对任意 $k \in \mathbb{N}_{\mathbf{p}}$ 和任意 $j \in \mathbb{N}_{\mathbf{q}}$ 有 $B_{\mathbf{p},k} \cap B_{\mathbf{q},j} = \emptyset$; 当 $\mathbf{p} = \mathbf{q}$ 时, 对任意 $k, j \in \mathbb{N}_{\mathbf{p}}, k \neq j$, 有 $B_{\mathbf{p},k} \cap B_{\mathbf{p},j} = \emptyset$. 将可数集 $\{B_{\mathbf{p},k}\}_{\mathbf{p} \in \mathbb{Z}_0^d, k \in \mathbb{N}_{\mathbf{p}}}$ 排成一系列 $\{B_k\}_{k \in \mathbb{N}_0}$ 其中 $\mathbb{N}_0 = \{1, 2, \dots, N\} (N \in \mathbb{N})$ 或 $\mathbb{N}_0 = \mathbb{N}$, 则 $B_k \in \mathcal{V}$ 互不相交且 $\bigcup_{k \in \mathbb{N}_0} B_k = \bigcup_{\mathbf{p} \in \mathbb{Z}_0^d, k \in \mathbb{N}_{\mathbf{p}}} B_{\mathbf{p},k}$, 因此

$$m^* \left(E \setminus \bigcup_{k \in \mathbb{N}_0} B_k \right) = m^* \left(E \setminus \bigcup_{\mathbf{p} \in \mathbb{Z}_0^d, k \in \mathbb{N}_{\mathbf{p}}} B_{\mathbf{p},k} \right) = 0. \quad \square$$

Vitali覆盖引理 有很多应用. 下面列出典型的几个.

【Vitali覆盖引理的应用1】 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为一非空开集. 则对任意 $\delta > 0$ 存在一系列直径 $\leq \delta$ 的互不相交的闭球 $B_k \subset \Omega, k = 1, 2, 3, \dots$, 使得

$$m \left(\Omega \setminus \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k \right) = 0.$$

【证】 前面例子中已说明闭球族 $\mathcal{V} = \{\overline{B}(x, r) \mid 0 < r \leq \delta, \overline{B}(x, r) \subset \Omega\}$ 是 Ω 的一个Vitali 覆盖. 由**Vitali覆盖引理**, 存在可数多个互不相交的闭球 $B_k \in \mathcal{V}, k \in \mathbb{N}_0$, 使得 $m(\Omega \setminus \bigcup_{k \in \mathbb{N}_0} B_k) = 0$, 其中 \mathbb{N}_0 是有限集或 $\mathbb{N}_0 = \mathbb{N}$. 若 \mathbb{N}_0 是有限集, 则 $\bigcup_{k \in \mathbb{N}_0} B_k$ 是闭集从而 $\Omega \setminus \bigcup_{k \in \mathbb{N}_0} B_k$ 是开集. 于是由 $m(\Omega \setminus \bigcup_{k \in \mathbb{N}_0} B_k) = 0$ 知 $\Omega \setminus \bigcup_{k \in \mathbb{N}_0} B_k = \emptyset$. 因一切 $B_k \subset \Omega$, 故得到 $\Omega = \bigcup_{k \in \mathbb{N}_0} B_k$ 从而 Ω 既开又闭. 这蕴含 $\Omega = \mathbb{R}^d$, 与 $m(\Omega) < \infty$ 矛盾. 因此只能是 $\mathbb{N}_0 = \mathbb{N}$. 所以 $m(\Omega \setminus \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k) = 0$. \square

【例】 从直观上看, **Vitali覆盖引理的应用1**有些意外. 例如对于平面闭矩形 $[0, 1] \times [0, 1]$, 可以证明 $[0, 1] \times [0, 1]$ 不能表示成互不重叠的非退化的闭圆盘的并. 但**Vitali覆盖引理的应用1**表明: 开矩形 $(0, 1) \times (0, 1)$ 可以表示成可数多个互不相交的闭球 B_k 的并外加一个2维零测集: $(0, 1) \times (0, 1) = Z_0 \cup \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k, m(Z_0) = 0$. 令 $Z = Z_0 \cup \partial((0, 1) \times (0, 1))$, 则 $m(Z) = 0$ 且 $[0, 1] \times [0, 1] = Z \cup \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k$. 这表明: $[0, 1] \times [0, 1]$ 可以表示成可数多个互不相交的闭圆盘的并外加一个2维零测集. 如果同学们用手在方块 $[0, 1] \times [0, 1]$ 内画出一个一个互不相交的小圆盘 B_1, B_2, B_3, \dots , 估计很多人不相信

剩余集 $[0, 1] \times [0, 1] \setminus \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k$ 可以是一个2维零测集。但是Vitali证明了这是可能的。所以不仅要有直观, 还要用严格论证来检验直观和纠正直观。这个例子就说明了这个道理: 直观与事实不一定总一致。 \square

【Vitali覆盖引理的应用2】 \mathbb{R}^d 中的任意多个闭球或闭方体的并集是 L -可测集。详细来说, 设 \mathcal{K} 是由 \mathbb{R}^d 中的若干个(包括不可数多个) 闭球或闭方体 K 组成的集合, 则并集

$$D := \bigcup_{K \in \mathcal{K}} K \text{ 是 } L\text{-可测集.}$$

进一步: 当 $d = 1$ 时(此时每个 B 都是闭区间), D 实际上是 F_σ -型集。但 $d \geq 2$ 时, 存在不可数多个闭球, 它们的并集不是Borel 集。

【证】 先看 $d = 1$ 的情形[此处特别感谢2016级杜信廷同学告知这一结果和其他一般结果.] 令 K° 为 K 的内部, 则由 K 是闭区间知 K° 是开区间。令 $G = \bigcup_{K \in \mathcal{K}} K^\circ$ 。则 G 是 \mathbb{R} 中的开集, 因此由 \mathbb{R} 中开集的结构定理知

$$G = \bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} (a_j, b_j), \text{ 其中 } (a_j, b_j) \text{ 是互不相交的有界或无界的开区间}$$

$\mathbb{N}_0 = \{1, 2, \dots, N\} (N \in \mathbb{N})$ 或 $\mathbb{N}_0 = \mathbb{N}$ 。令

$$Z = D \cap \{a_j, b_j \mid j \in \mathbb{N}_0\}.$$

易见 Z 是可数集。来证明

$$D = G \cup Z.$$

显然有 $G \cup Z \subset D$ 。为证反向包含, 先证明对任意 $K \in \mathcal{K}$, 存在 $j \in \mathbb{N}_0$ 使得 $K^\circ \subset (a_j, b_j)$ 从而有

$$K = \overline{K^\circ} \subset \overline{(a_j, b_j)} = \begin{cases} (-\infty, b_j] & \text{if } -\infty = a_j < b_j < \infty \\ [a_j, b_j] & \text{if } -\infty < a_j < b_j < \infty \\ [a_j, +\infty) & \text{if } -\infty < a_j < b_j = +\infty \end{cases}$$

事实上由 G 的定义和上面的分解式知

$$K^\circ = \bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} K^\circ \cap (a_j, b_j).$$

注意 $K^\circ \cap (a_j, b_j)$ 也是互不相交的开集。因 K° 是连通开集(开区间!), 故由连通开集的性质知这些互不相交的开集 $K^\circ \cap (a_j, b_j)$ 中只有一个是非空的。所以存在 $j \in \mathbb{N}_0$ 使

得 $K^\circ = K^\circ \cap (a_j, b_j) \subset (a_j, b_j)$. 现在任取 $x \in D$, 则存在 $K \in \mathcal{K}$ 使得 $x \in K$. 对这个 K , 在 $j \in \mathbb{N}_0$ 使得 $K^\circ \subset (a_j, b_j)$ 从而有 $x \in K \subset \overline{(a_j, b_j)}$. 若 $x \in (a_j, b_j)$, 则 $x \in G$; 若 $x \notin (a_j, b_j)$, 则必有 $x \in \{a_j, b_j\}$ 从而有 $x \in Z$. 这证明了 $x \in G \cup Z$. 所以 $D \subset G \cup Z$. 所以 $D = G \cup Z$. 最后由开集和可数集都是 F_σ -型集以及可数个 F_σ -型集的并也是 F_σ -型集可知 $D = G \cup Z$ 是 F_σ -型集。

下面对于 $d \geq 2$ 的情形证明 D 是 L -可测集. 令

$$G = \bigcup_{K \in \mathcal{K}} K^\circ, \quad E = \bigcup_{K \in \mathcal{K}} \partial K.$$

则 G 是开集且

$$D = G \cup E.$$

来做 E 的一个 Vitali 覆盖. 任取 $K \in \mathcal{K}$. 先设 $K = \overline{B}(a, r)$ 是闭球. 对任意 $x \in \partial K$ 和任意 $0 < \delta < r$, 令 $\theta = \delta/r, b = (1 - \theta)x + \theta a$, 则有 $x \in \overline{B}(b, \delta) \subset K$.

[详细: 我们有 $|x - b| = \theta|a - x| = \theta r = \delta$ 因此 $x \in \partial B(b, \delta) \subset \overline{B}(b, \delta)$. 而对任意 $y \in \overline{B}(b, \delta)$ 有 $|y - a| \leq |y - b| + |b - a| \leq \delta + (1 - \theta)|x - a| = \delta + (1 - \theta)r = \theta r + (1 - \theta)r = r$. 所以 $y \in K$, 所以 $\overline{B}(b, \delta) \subset K$.]

其次设 $K = \prod_{i=1}^d [a_i, a_i + l]$ 闭方体. 对任意 $x = (x_1, x_2, \dots, x_d) \in \partial K$ 和任意 $0 < \delta < l/2$, 对每个 $i \in \{1, 2, \dots, d\}$ 令

$$b_i = x_i \text{ 当 } a_i \leq x_i < a_i + l/2; \quad b_i = x_i - \delta \text{ 当 } a_i + l/2 \leq x_i \leq a_i + l.$$

$$\text{则 } x \in \prod_{i=1}^d [b_i, b_i + \delta] \subset K.$$

将所有这样做成的闭球 $\overline{B}(b, \delta)$ 和或闭方体 $\prod_{i=1}^d [b_i, b_i + \delta]$ 做成一个集合 \mathcal{V} . 来证明 \mathcal{V} 是 E 的一个 Vitali 覆盖且 \mathcal{V} 中每个成员是 \mathcal{K} 中某个成员的子集.

事实上对任意 $x \in E$, 存在 $K \in \mathcal{K}$ 使得 $x \in \partial K$. 对任意 $\varepsilon > 0$, 由上面做法知存在 $B \in \mathcal{V}$ 使得 $x \in B \subset K$ 且 $\text{diam}(B) < \varepsilon$. 所以 \mathcal{V} 是 E 的一个 Vitali 覆盖且具有所说的性质.

据 Vitali 覆盖引理, 存在可数子集 $\{B_j\}_{j \in \mathbb{N}_0} \subset \mathcal{V}$, 其中 B_j 互不相交, $\mathbb{N}_0 = \{1, 2, \dots, N\}$ ($N \in \mathbb{N}$) 或 $\mathbb{N}_0 = \mathbb{N}$, 使得 $m^*(E \setminus \bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} B_j) = 0$. 令 $Z_1 = E \setminus \bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} B_j$, 则 $m(Z_1) = 0$ 且

$$E = Z_1 \cup \left(E \cap \bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} B_j \right) = Z_1 \cup \bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} E \cap B_j.$$

令

$$Z_2 = \bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} E \cap \partial B_j.$$

则由于 d 维闭球和闭方体的边界都是 d 维零测集, 故 Z_2 是零测集. 易见

$$E = Z_1 \cup Z_2 \cup \bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} E \cap B_j^\circ.$$

由 \mathcal{V} 的做法可知, 对每个 B_j , 存在 $K \in \mathcal{K}$ 使得 $B_j \subset K$, 从而有 $B_j^\circ \subset K^\circ \subset G$. 这表明, 对每个 $j \in \mathbb{N}_0$ 都有 $B_j^\circ \subset G$. 于是得到 $\bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} B_j^\circ \subset G$ 从而有

$$E \subset Z_1 \cup Z_2 \cup \bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} B_j^\circ \subset Z_1 \cup Z_2 \cup G.$$

由此和 $Z_1 \cup Z_2 \subset E$ 得到

$$D = G \cup E \subset G \cup Z_1 \cup Z_2 \subset G \cup E = D$$

所以

$$D = G \cup Z_1 \cup Z_2.$$

因 G 是开集从而是 L -可测集, $Z_1 \cup Z_2$ 是 L -零测集从而是 L -可测集, 故 D 是 L -可测集。

最后对于 $d \geq 2$ 来做出不可数多个闭球使得它们的并集不是Borel 集.

设 W 是 \mathbb{R}^{d-1} 中的一个Lebesgue 不可测集. 则 W 当然不是Borel 集. 考虑以 $W \times \{0\}$ 正的点为中心的闭单位球的并:

$$D = \bigcup_{a \in W \times \{0\}} \overline{B}(a, 1).$$

则易见

$$(\mathbb{R}^{d-1} \times \{1\}) \cap D = W \times \{1\}.$$

若 D 是Borel 集, 则由两个Borel集的交还是Borel 集知 $W \times \{1\}$ 应是Borel 集. 因 $x \mapsto f(x) = (x, 1)$ 是 $\mathbb{R}^{d-1} \rightarrow \mathbb{R}^{d-1} \times \{1\}$ 的同胚, 故由 $f(W) = W \times \{1\}$ 是Borel 集知 W 也应是Borel 集, 这就产生矛盾. 所以并集 D 不是Borel集. \square

【Vitali覆盖引理的应用3】 见第三章第1节关于Lebesgue微分定理的证明.

习题课(2018-3-23)

1. (可数覆盖) 设集合 $E \subset \mathbb{R}^d$ 被 \mathbb{R}^d 的开集族 \mathcal{G} 覆盖. 则存在可数子族 $\{U_j\}_{j \in \mathbb{N}_0} \subset \mathcal{G}$ 使得 $\{U_j\}_{j \in \mathbb{N}_0}$ 仍然覆盖 E , 这里 $\mathbb{N}_0 = \{1, 2, \dots, N\}$ ($N \in \mathbb{N}$) 或 $\mathbb{N}_0 = \mathbb{N}$.

【证】由假设有 $E \subset \bigcup_{U \in \mathcal{G}} U$. 应用开集的方体分解定理知 $\bigcup_{U \in \mathcal{G}} U = \bigcup_{k=1}^{\infty} Q_k$ 其中 Q_k 是互不相交的左闭右开的方体. 对每个 $k \in \mathbb{N}$, 易知存在 $U_k \in \mathcal{G}$ 使得 $Q_k \cap U_k \neq \emptyset$. 于是有 $\bigcup_{k=1}^{\infty} Q_k = \bigcup_{k=1}^{\infty} U_k$. 对序列 $\{U_k\}_{k=1}^{\infty}$, 由命题1.1.0知存在 $\mathbb{N}_0 \subset \mathbb{N}$ 如上使得 U_{k_j} ($j \in \mathbb{N}_0$) 互不相同且对任意 $k \in \mathbb{N}$ 有 $U_k \in \{U_{k_j}\}_{j \in \mathbb{N}_0}$. 这给出 $\bigcup_{k=1}^{\infty} U_k = \bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} U_{k_j}$. 调整记号: 将 U_{k_j} 记作 U_j 即得 $E \subset \bigcup_{j \in \mathbb{N}_0} U_j$. \square

2. 设 $\mathcal{M} = \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 为 \mathbb{R}^d 中 L -可测集的全体, 集合 $A, B \subset \mathbb{R}^d$ 满足

$$A \cup B \in \mathcal{M}, \quad m(A \cup B) = m^*(A) + m^*(B) < \infty. \quad (1)$$

证明 $A \in \mathcal{M}, B \in \mathcal{M}$ 且 $m(A \cap B) = 0$.

【证】首先证明若 $A, B \in \mathcal{M}$ (从而 $A \cap B \in \mathcal{M}$), 则有 $m(A \cap B) = 0$. 事实上若 $A, B \in \mathcal{M}$, 则由关于可测集的等式

$$m(A \cup B) + m(A \cap B) = m(A) + m(B)$$

和 $m(A) = m^*(A), m(B) = m^*(B)$ 以及(1)得到

$$m(A \cup B) + m(A \cap B) = m(A \cup B) < \infty.$$

因此 $m(A \cap B) = 0$.

下证 $A, B \in \mathcal{M}$. 由集合外测度的等价定义 $m^* = m_{\text{open}}^*$ 易见存在 G_δ -型集合 $H_A \supset A$ 和 $H_B \supset B$ 使得 $m(H_A) = m^*(A), m(H_B) = m^*(B)$ (这只是说明等测包存在).

结合假设(1)有

$$\begin{aligned} m(A \cup B) &= m^*(A) + m^*(B) = m(H_A) + m(H_B) \\ &= m(H_A \cup H_B) + m(H_A \cap H_B) \geq m(A \cup B) + m(H_A \cap H_B) \end{aligned} \quad (2)$$

因 $m(A \cup B) < \infty$ 故这蕴含 $m(H_A \cap H_B) = 0$. 于是再由(2)得知

$$m(A \cup B) = m(H_A \cup H_B).$$

但 $H_A \cup H_B \supset A \cup B$, 故再由 $m(A \cup B) < \infty$ 得到

$$m((H_A \cup H_B) \setminus (A \cup B)) = m(H_A \cup H_B) - m(A \cup B) = 0.$$

以上证明了

$$m(H_A \cap H_B) = 0, \quad m((H_A \cup H_B) \setminus (A \cup B)) = 0.$$

下证

$$H_A \setminus A \subset [(H_A \cup H_B) \setminus (A \cup B)] \cup [H_A \cap H_B]. \quad (3)$$

对任意 $x \in H_A \setminus A$, 有 $x \in H_A, x \notin A$. 若 $x \notin H_A \cap H_B$ 则必有 $x \notin H_B$ 从而有 $x \notin B$ 这蕴含 $x \notin A \cup B$ 从而 $x \in (H_A \cup H_B) \setminus (A \cup B)$. 所以(3) 成立. 因(3)式右边是 L -零测集, 故 $H_A \setminus A \in \mathcal{M}$ 也是 L -零测集从而属于 \mathcal{M} . 于是由 $A = H_A \setminus (H_A \setminus A)$ 即知 $A \in \mathcal{M}$. 同理可证 $B \in \mathcal{M}$. \square

3. 【一维Vitali覆盖引理】(这是上面**Vitali覆盖引理**之前的版本, 证法相同.)

4. 本题学习Lebesgue 测度的平移不变性的应用和一类可测集之间的独立性。

对 $[0, 1)$ 中的每个子集 S , 令 S_{ir} 为 S 中的无理数的全体, 即 $S_{\text{ir}} = S \setminus \mathbb{Q}$. 设

$$A_k = \bigcup_{j=1}^{2^{k-1}} \left[\frac{2j-2}{2^k}, \frac{2j-1}{2^k} \right)_{\text{ir}}, \quad B_k = \bigcup_{j=1}^{2^{k-1}} \left[\frac{2j-1}{2^k}, \frac{2j}{2^k} \right)_{\text{ir}}, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

对每个 $k \in \mathbb{N}$ 随意取定 $E_k \in \{A_k, B_k\}$.

证明: 这样取定的集合列 $\{E_k\}_{k=1}^{\infty}$ 具有下列性质:

$$m(E_k) = \frac{1}{2}, \quad k = 1, 2, 3, \dots;$$

对任意 $n \in \mathbb{N}$ 和任意正整数 $1 \leq k_1 < k_2 < \dots < k_n$ 都有

$$m(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \dots \cap E_{k_n}) = m(E_{k_1})m(E_{k_2}) \dots m(E_{k_n}) = \left(\frac{1}{2}\right)^n.$$

(用概率论的语言来说, E_1, E_2, E_3, \dots 是 $[0, 1)$ 中互相独立的事件. 这个例子有助于消除概率论中的重要概念——相互独立——的“神秘性”。)

此外证明对任意任意正整数子列 $1 \leq k_1 < k_2 < k_3 < \dots$ 有

$$m\left(\bigcap_{n=1}^{\infty} E_{k_n}\right) = 0, \quad m\left(\bigcap_{j=1}^{\infty} \bigcup_{n=j}^{\infty} E_{k_n}\right) = 1.$$

【证】 由 A_k, B_k 的定义易见

$$[0, 1)_{\text{ir}} = A_k \cup B_k, \quad A_k \cap B_k = \emptyset, \quad A_k + \frac{1}{2^k} = B_k$$

因此由无理数集是满测度集和平移不变性有

$$1 = m([0, 1]_{\text{ir}}) = m(A_k) + m(B_k) = 2m(A_k) = 2m(B_k)$$

所以

$$m(A_k) = m(B_k) = \frac{1}{2}. \quad \text{因此} \quad m(E_k) = \frac{1}{2} \quad \forall E_k \in \{A_k, B_k\}.$$

由小数的2-进表示易见

$$A_k = \{x \in [0, 1]_{\text{ir}} \mid x \text{ 的2-进制表示 } x = 0.a_1a_2a_3\ldots = \sum_{i=1}^{\infty} \frac{a_i}{2^i} \text{ 中的第 } k \text{ 位数字 } a_k = 0\},$$

$$B_k = \{x \in [0, 1]_{\text{ir}} \mid x \text{ 的2-进制表示 } x = 0.a_1a_2a_3\ldots = \sum_{i=1}^{\infty} \frac{a_i}{2^i} \text{ 中的第 } k \text{ 位数字 } a_k = 1\}.$$

这里需要回顾事实: 无理数的2-进制表示是唯一的, 即若 $x \in [0, 1]_{\text{ir}}$, 则它的2-进制表示 $x = \sum_{i=1}^{\infty} \frac{a_i}{2^i}$ 中的所有 $a_1, a_2, a_3, \ldots \in \{0, 1\}$ 由 x 唯一确定。

对任意 $E_k \in \{A_k, B_k\}$, 令 $a_k(E_k)$ 为 E_k 中的小数的2-进表示中的第 k 位数字, 即

$$a_k(E_k) = \begin{cases} 0 & \text{if } E_k = A_k \\ 1 & \text{if } E_k = B_k. \end{cases}$$

令

$$E_k^c = [0, 1]_{\text{ir}} \setminus E_k.$$

则易见 $E_k^c \in \{A_k, B_k\}$ 且

$$a_k(E_k^c) = 1 - a_k(E_k).$$

对任意 $n \in \mathbb{N}$, 任意互不相同的自然数 $1 \leq k_1 < k_2 < \cdots < k_n$ 和任意选择

$E_{k_1} \in \{A_{k_1}, B_{k_1}\}, E_{k_2} \in \{A_{k_2}, B_{k_2}\}, \dots, E_{k_n} \in \{A_{k_n}, B_{k_n}\}$, 成立平移关系:

$$E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n} = A_{k_1} \cap A_{k_2} \cap \cdots \cap A_{k_n} + h_n \quad (6)$$

其中

$$h_n = \frac{a_{k_1}(E_{k_1})}{2^{k_1}} + \frac{a_{k_2}(E_{k_2})}{2^{k_2}} + \cdots + \frac{a_{k_n}(E_{k_n})}{2^{k_n}}.$$

事实上 $x \in E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n} \iff x$ 的2-进制表示中的第 k_1, k_2, \dots, k_n 位的数字分别是 $a_{k_1}(E_{k_1}), a_{k_2}(E_{k_2}), \dots, a_{k_n}(E_{k_n})$ (这蕴含 $x - h_n \geq 0$) $\iff x - h_n$ 的2-进制表示中的第 k_1, k_2, \dots, k_n 位都是0 $\iff x - h_n \in A_{k_1} \cap A_{k_2} \cap \cdots \cap A_{k_n} \iff x \in A_{k_1} \cap A_{k_2} \cap \cdots \cap A_{k_n} + h_n$. 所以(6)成立。

由这一平移关系得到

$$m(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n}) = m(A_{k_1} \cap A_{k_2} \cap \cdots \cap A_{k_n}).$$

据此不难证明

$$m(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n}) = \left(\frac{1}{2}\right)^n \quad \forall 1 \leq k_1 < k_2 < \cdots < k_n.$$

事实上当集合的个数 $n = 1$ 时, 这等式成立。假设在集合的个数为 n 时成立, 看集合个数为 $n + 1$ 时: 注意 $[0, 1]_{\text{ir}} = E_{k_{n+1}} \cup E_{k_{n+1}}^c$ (不交并) 有

$$E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n} = \left(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n} \cap E_{k_{n+1}}\right) \cup \left(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n} \cap E_{k_{n+1}}^c\right).$$

同时有

$$\begin{aligned} m(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n} \cap E_{k_{n+1}}) &= m(A_{k_1} \cap A_{k_2} \cap \cdots \cap A_{k_{n+1}}) \\ &= m(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n} \cap E_{k_{n+1}}^c). \end{aligned}$$

因此

$$\begin{aligned} m(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n}) &= m(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n} \cap E_{k_{n+1}}) \\ &+ m(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n} \cap E_{k_{n+1}}^c) = 2m(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n} \cap E_{k_{n+1}}) \end{aligned}$$

所以

$$m(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n} \cap E_{k_{n+1}}) = \frac{1}{2} m(E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_n}) = \left(\frac{1}{2}\right)^{n+1}.$$

由归纳法原理, 所证等式成立。

最后对每个 $k \in \mathbb{N}$ 随意取定 $E_k \in \{A_k, B_k\}$. 对任意任意正整数子列 $1 \leq k_1 < k_2 < k_3 < \cdots$, 由上面证明的结果有

$$m\left(\bigcap_{n=j}^{\infty} E_{k_n}\right) = \lim_{N \rightarrow \infty} m\left(\bigcap_{n=j}^{j+N} E_{k_n}\right) = 0, \quad j = 1, 2, 3, \dots$$

因 E_k^c 与 E_k 地位相同, 故也有

$$m\left(\bigcap_{n=j}^{\infty} E_{k_n}^c\right) = 0, \quad j = 1, 2, 3, \dots$$

于是

$$[0, 1]_{\text{ir}} \setminus \bigcap_{j=1}^{\infty} \bigcup_{n=j}^{\infty} E_{k_n} = \bigcup_{j=1}^{\infty} \bigcap_{n=j}^{\infty} E_{k_n}^c = \text{等于可数个零测集的并}$$

因此

$$m\left([0,1]_{\text{ir}} \setminus \bigcap_{j=1}^{\infty} \bigcup_{n=j}^{\infty} E_{k_n}\right) = 0 \quad \text{所以} \quad m\left(\bigcap_{j=1}^{\infty} \bigcup_{n=j}^{\infty} E_{k_n}\right) = 1.$$

□

5. 设 $E_k \in \mathcal{M} = \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ ($k = 1, 2, 3, \dots$) 和 $\varepsilon > 0$ 满足

$$m(E_k) \geq \varepsilon, \quad k = 1, 2, 3, \dots; \quad m\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k\right) < \infty.$$

证明

$$m\left(\bigcap_{j=1}^{\infty} \bigcup_{k=j}^{\infty} E_k\right) \geq \varepsilon > 0.$$

因此特别可知存在子列 $1 \leq k_1 < k_2 < k_3 < \dots$ 使得

$$\bigcap_{n=1}^{\infty} E_{k_n} \neq \emptyset.$$

但是可以出现这样的情形:

对于严格递增的任意正整数列 $1 \leq k_1 < k_2 < k_3 < \dots$, 都有 $m(\bigcap_{n=1}^{\infty} E_{k_n}) = 0$.

【证】我们有

$$\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k \supset \bigcup_{k=2}^{\infty} E_k \supset \bigcup_{k=3}^{\infty} E_k \supset \dots, \quad m\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k\right) < \infty.$$

因

$$m\left(\bigcup_{k=j}^{\infty} E_k\right) \geq m(E_j) \geq \varepsilon, \quad j = 1, 2, 3, \dots$$

故由测度的单调极限定理即得

$$m\left(\bigcap_{j=1}^{\infty} \bigcup_{k=j}^{\infty} E_k\right) = \lim_{j \rightarrow \infty} m\left(\bigcup_{k=j}^{\infty} E_k\right) \geq \varepsilon > 0.$$

这个测度 > 0 蕴含 $\bigcap_{j=1}^{\infty} \bigcup_{k=j}^{\infty} E_k \neq \emptyset$. 取 $x_0 \in \bigcap_{j=1}^{\infty} \bigcup_{k=j}^{\infty} E_k$.

则对于 $j = 1$ 有 $x_0 \in \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k$, 因此存在 $k_1 \geq 1$ 使得 $x_0 \in E_{k_1}$.

对于 $j = k_1 + 1$ 有 $x_0 \in \bigcup_{k=k_1+1}^{\infty} E_k$, 因此存在 $k_2 \geq k_1 + 1$ 使得 $x_0 \in E_{k_2}$.

对于 $j = k_2 + 1$ 有 $x_0 \in \bigcup_{k=k_2+1}^{\infty} E_k$, 因此存在 $k_3 \geq k_2 + 1$ 使得 $x_0 \in E_{k_3}$.

如此操作下去, 用归纳法, 我们得到严格递增的自然数列 $1 \leq k_1 < k_2 < k_3 < \dots$ 使得 $x_0 \in \bigcap_{n=1}^{\infty} E_{k_n}$. 所以 $\bigcap_{n=1}^{\infty} E_{k_n} \neq \emptyset$.

最后我们来构造一个使得任何交集 $\bigcap_{n=1}^{\infty} E_{k_n}$ 皆为零测集的 $\{E_k\}_{k=1}^{\infty}$ 的例子.

可以假设 $d \geq 2$ (此时的证明过程已包含了对 $d = 1$ 时的证明, 或者对 $d = 1$ 的情形直接用第3题的结果). 令 $A_k \subset [0, 1)$ 为第3题中的集合, 即 $A_k = \bigcup_{j=1}^{2^{k-1}} \left[\frac{2j-2}{2^k}, \frac{2j-1}{2^k} \right)_{\text{ir}}$, 令

$$E_k = A_k \times [0, 1)^{d-1}, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

则有

$$E_k = \bigcup_{j=1}^{2^{k-1}} \left[\frac{2j-2}{2^k}, \frac{2j-1}{2^k} \right)_{\text{ir}} \times [0, 1)^{d-1} = \left(\bigcup_{j=1}^{2^{k-1}} \left[\frac{2j-2}{2^k}, \frac{2j-1}{2^k} \right) \times [0, 1)^{d-1} \right) \setminus Z$$

其中 $Z \subset \mathbb{Q} \times [0, 1)^{d-1}$ 因而 Z 是 d 维零测集. 于是由可加性和 L -测度保持区间体积有

$$m(E_k) = \sum_{j=1}^{2^{k-1}} m\left(\left[\frac{2j-2}{2^k}, \frac{2j-1}{2^k}\right) \times [0, 1)^{d-1}\right) = 2^{k-1} \frac{1}{2^k} = \frac{1}{2}, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

同时由

$$\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k \subset [0, 1)^d \quad \text{有} \quad m\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k\right) \leq 1 < \infty.$$

易见对任意子列 $1 \leq k_1 < k_2 < k_3 < \dots$ 有

$$\bigcap_{n=1}^{\infty} E_{k_n} = \bigcap_{n=1}^{\infty} (A_{k_n} \times [0, 1)^{d-1}) = \left(\bigcap_{n=1}^{\infty} A_{k_n} \right) \times [0, 1)^{d-1}.$$

因 $\bigcap_{n=1}^{\infty} A_{k_n}$ 是一维零测集(这是第3题结果), 故由零测集性质知 $\bigcap_{n=1}^{\infty} E_{k_n}$ 是 d 维零测集, 即 $m(\bigcap_{n=1}^{\infty} E_{k_n}) = 0$. 【当然, 据本题前半部分的结果知存在严格递增的自然数列 $1 \leq k_1 < k_2 < k_3 < \dots$ 使得 $\bigcap_{n=1}^{\infty} E_{k_n} \neq \emptyset$. 事实上取定一个 $t_0 \in [0, 1)_{\text{ir}}$, 即 t_0 是 $[0, 1)$ 中的无理数. 做2-进展开 $t_0 = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{a_k}{2^k}$, $a_k \in \{0, 1\}$. 令 $N_1 = \{k \in \mathbb{N} \mid a_k = 0\}$. 则 N_1 是无限集(否则将导致 t_0 是有理数, 矛盾). 将 N_1 中元素按递增排成一列: $N_1 = \{k_1, k_2, k_3, \dots\}$, $1 \leq k_1 < k_2 < k_3 < \dots$. 则有 $t_0 \in \bigcap_{n=1}^{\infty} A_{k_n}$. 于是有 $(t_0, 0, \dots, 0) \in (\bigcap_{n=1}^{\infty} A_{k_n}) \times [0, 1)^{d-1} = \bigcap_{n=1}^{\infty} E_{k_n}$.】 \square

6. 设 $B_r(0) = \{x \in \mathbb{R}^2 \mid |x| < r\}$ (=以原点为中心以 $r > 0$ 为半径的开圆盘), $A \in \mathbb{R}^{2 \times 2}$ 为一个旋转变换(正交矩阵), $E \subset B_r(0)$ 为一 L -可测集, n 为正整数. 假设对每个 $x \in B_r(0)$, 存在 $k \in \{0, 1, 2, \dots, n\}$ 使得 $A^k x \in E$. 证明

$$m(E) \geq \frac{\pi r^2}{n+1}.$$

这里可以承认事实 $m(B_r(0)) = \pi r^2$.

【证】(建议先让学生考虑几分钟) 由假设和 $A^k x \in E \iff x \in A^{-k}(E)$ 有

$$B_r(0) \subset \bigcup_{k=0}^n A^{-k}(E).$$

因此

$$\pi r^2 = m(B_r(0)) \leq \sum_{k=0}^n m(A^{-k}(E)) = \sum_{k=0}^n |\det(A^{-k})| m(E) = (n+1)m(E)$$

所以 $m(E) \geq \frac{\pi r^2}{n+1}$. 这里用到事实: 逆矩阵 A^{-k} 也是正交阵从而有 $|\det(A^{-k})| = 1$. \square

§1.8. 可测函数和简单函数逼近

有了可测集和测度, 还需要建立可测函数类, 它将用于定义和研究函数的积分——因为不可能对所有函数都能定义积分。

【记号】 在分析学和概率论中, 广义实值函数 $f : E \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 在集合 $B \subset [-\infty, +\infty]$ 下的逆象集 $f^{-1}(B)$ 也常被写成直观的形式:

$$f^{-1}(B) = E(f \in B) := \{x \in E \mid f(x) \in B\}.$$

注意, 记号 $f^{-1}(B)$ 没有显示 f 的定义域, 而记号 $E(f \in B)$ 给出了 f 的定义域 E .

例

$$E(f > t) = E(f \in [t, +\infty]) = f^{-1}([t, +\infty]) = \{x \in E \mid f(x) > t\},$$

$$E(f < t) = E(f \in [-\infty, t)) = f^{-1}([-\infty, t)) = \{x \in E \mid f(x) < t\},$$

$$E(a \leq f < b) = E(f \in [a, b)) = f^{-1}([a, b)) = \{x \in E \mid a \leq f(x) < b\},$$

$$E(f > g) = \{x \in E \mid f(x) > g(x)\}, \quad E(f \neq g) = \{x \in E \mid f(x) \neq g(x)\}, \quad \text{etc.}$$

可测函数的定义有几个等价的版本, 我们采用下面这个比较广泛使用的版本:

【定义(广义实值可测函数)】

设 $\mathcal{M} = \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 为 \mathbb{R}^d 中 L -可测集的全体, $E \in \mathcal{M}$, $f : E \rightarrow [-\infty, +\infty]$. 如果

$$E(f > t) \in \mathcal{M} \quad \forall t \in \mathbb{R}$$

则称 f 是 E 上的一个广义实值 L -可测函数, 也称 f 在 E 上 L -可测。若 f 是 E 上的广义实值 L -可测函数且 f 的值域含于 \mathbb{R} , 则称 f 是 E 上的实值 L -可测函数。当上下文清楚时, L -可测函数也简称为可测函数。此外我们规定: 任何函数都在空集上可测。 \square

【注】 上述定义及其导出的结果(见下面)体现了测度论的一大特点: 很多情况下, 问题的处理是从函数的值域着手, 从值域上设定的性质来确定定义域应提供的性质。

在学习可测函数基本性质之前, 先看可测函数的典型例子。

【例】 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 是 L -可测集, $f : E \rightarrow \mathbb{R}$ 连续. 则 f 是 E 上的可测函数。

【证】 任取 $t \in \mathbb{R}$, 要证明 $E(f > t)$ 是可测集. 为此我们证明更强的结果: 存在开集 $U_t \subset \mathbb{R}^d$ 使得

$$E(f > t) = U_t \cap E. \tag{1.8.1}$$

因开集是可测集、可数个可测集的交是可测集, 故 $E(f > t) = U_t \cap E$ 是可测集, 因此 f 在 E 上可测.

为证(1.8.1), 任取 $x \in E(f > t)$, 即 $x \in E, f(x) > t$. 因 f 连续, 故对于 $f(x) - t > 0$, 存在 $\delta_x = \delta_{x,t} > 0$ 使得当 $y \in B(x, \delta_x) \cap E$ 时 $|f(y) - f(x)| < f(x) - t$. 这蕴含 $f(y) > t$, 即 $y \in E(f > t)$. 因此 $B(x, \delta_x) \cap E \subset E(f > t)$. 由此我们得到

$$E(f > t) \subset \bigcup_{x \in E(f > t)} B(x, \delta_x) \cap E \subset E(f > t).$$

令

$$U_t = \bigcup_{x \in E(f > t)} B(x, \delta_x)$$

则 U_t 是开集且 $E(f > t) = U_t \cap E$. \square

【命题1.8.1】 设 $\mathcal{M} = \mathcal{M}(\mathbb{R}^d), E \in \mathcal{M}, f : E \rightarrow [-\infty, +\infty]$. 则

(a) 以下(1),(2),(3),(4) 四类可测性彼此等价, 因此其中任何一个都可作为可测函数的定义:

- (1) $E(f > t) \in \mathcal{M} \quad \forall t \in \mathbb{R}.$ (2) $E(f \geq t) \in \mathcal{M} \quad \forall t \in \mathbb{R}.$
(3) $E(f < t) \in \mathcal{M} \quad \forall t \in \mathbb{R}.$ (4) $E(f \leq t) \in \mathcal{M} \quad \forall t \in \mathbb{R}.$

(b) 设 f 可测。则(由(a))

$$E(f = t) = E(f \leq t) \cap E(f \geq t) \in \mathcal{M},$$

$$E(f < \infty) = \bigcup_{k=1}^{\infty} E(f < k) \in \mathcal{M},$$

$$E(f > -\infty) = \bigcup_{k=1}^{\infty} E(f > -k) \in \mathcal{M},$$

$$E(|f| < \infty) = E(f < \infty) \cap E(f > -\infty) \in \mathcal{M},$$

$$E(f = +\infty) = \bigcap_{k=1}^{\infty} E(f > k) \in \mathcal{M},$$

$$E(f = -\infty) = \bigcap_{k=1}^{\infty} E(f \leq -k) \in \mathcal{M}.$$

(c) 设 f 可测, 则对任意Borel 集 $B \subset \mathbb{R}$ 有 $E(f \in B) \in \mathcal{M}$.

【证】 只需证(a) 和(c). 对于(a) 我们有

$$\begin{aligned} x \in E(f > t) &\iff x \in E \text{ 且 } f(x) > t \iff x \in E \text{ 且 } \exists k \in \mathbb{N} \text{ s.t. } f(x) \geq t + 1/k \\ &\iff \exists k \in \mathbb{N} \text{ s.t. } x \in E(f \geq t + 1/k) \iff x \in \bigcup_{k=1}^{\infty} E(f \geq t + 1/k). \end{aligned}$$

同理有

$$\begin{aligned} x \in E(f \geq t) &\iff x \in E \text{ 且 } f(x) \geq t \iff x \in E \text{ 且 } f(x) > t - 1/k \quad \forall k \in \mathbb{N} \\ &\iff x \in E(f > t - 1/k) \quad \forall k \in \mathbb{N} \iff x \in \bigcap_{k=1}^{\infty} E(f > t - 1/k). \end{aligned}$$

所以

$$E(f > t) = \bigcup_{k=1}^{\infty} E(f \geq t + 1/k), \quad E(f \geq t) = \bigcap_{k=1}^{\infty} E(f > t - 1/k).$$

因此 (1) 与 (2) 等价.

同法可证对任意 $t \in \mathbb{R}$ 有

$$E(f < t) = \bigcup_{k=1}^{\infty} E(f \leq t - 1/k), \quad E(f \leq t) = \bigcap_{k=1}^{\infty} E(f < t + 1/k).$$

因此 (3) 与 (4) 等价. 而由 $E \in \mathcal{M}$ 和

$$E(f \geq t) = E \setminus E(f < t), \quad E(f < t) = E \setminus E(f \geq t)$$

可见 (2) 与 (3) 等价. 这证明了蕴涵关系 (1) \iff (2) \iff (3) \iff (4) 成立.

下证 (c). 令

$$\mathcal{A} = \{B \in \mathcal{B}(\mathbb{R}) \mid E(f \in B) \in \mathcal{M}\}.$$

则要证明的是 $\mathcal{A} = \mathcal{B}(\mathbb{R})$. 为此只需证明 \mathcal{A} 是一个 σ -代数并且 \mathcal{A} 包含了 \mathbb{R} 中所有开集. 如果这件事成立, 则由 Borel σ -代数的定义——包含所有开集的最小 σ -代数——可知 $\mathcal{A} \supset \mathcal{B}(\mathbb{R})$. 但已有 $\mathcal{A} \subset \mathcal{B}(\mathbb{R})$, 所以 $\mathcal{A} = \mathcal{B}(\mathbb{R})$.

我们有

$$\begin{aligned} E(f \in \mathbb{R}) &= \bigcup_{n=1}^{\infty} (E(f > -n) \cap E(f < n)) \in \mathcal{M} \implies \mathbb{R} \in \mathcal{A}, \\ B \in \mathcal{A} &\implies E(f \in B^c) = E(f \in \mathbb{R}) \setminus E(f \in B) \in \mathcal{M} \implies B^c \in \mathcal{A}, \\ B_k \in \mathcal{A}, k = 1, 2, \dots, &\implies E(f \in \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k) = \bigcup_{k=1}^{\infty} E(f \in B_k) \in \mathcal{M} \implies \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k \in \mathcal{A}. \end{aligned}$$

所以 \mathcal{A} 是 \mathbb{R} 上的一个 σ -代数. 进一步, 对任何有界或无界开区间 $(a, b) \subset \mathbb{R}$ 有

$$E(f \in (a, b)) = E(f > a) \cap E(f < b) \in \mathcal{M} \implies (a, b) \in \mathcal{A}.$$

最后对任意开集 $\mathcal{O} \subset \mathbb{R}$, 由一维开集的结构定理知存在可数多个(互不相交的)开区间 (a_k, b_k) 使得

$$\mathcal{O} = \bigcup_{k \geq 1} (a_k, b_k).$$

于是有

$$E(f \in \mathcal{O}) = \bigcup_{k \geq 1} E(f \in (a_k, b_k)) \in \mathcal{M} \implies \mathcal{O} \in \mathcal{A}.$$

所以 \mathcal{A} 包含了 \mathbb{R} 中的所有开集. 因此如上所说这就证明了 $\mathcal{A} = \mathcal{B}(\mathbb{R})$. \square

【例】 设 $E \in \mathcal{M}$, $f : E \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 为 \mathcal{M} -可测. 则取开集 $B = \mathbb{R} \setminus \{0\}$ 可知

$$E(0 < |f| < \infty) = E(f \in \mathbb{R} \setminus \{0\}) \in \mathcal{M}.$$

\square

【例】 设 $A \subset \mathbb{R}^d$. 则有

A 是可测集 \iff 特征函数 $\mathbf{1}_A(x)$ 是 \mathbb{R}^d 上的可测函数。

这是由于下面等式: 对任意 $t \in \mathbb{R}$ 有

$$\mathbb{R}^d(\mathbf{1}_A > t) = \begin{cases} \mathbb{R}^d & \text{if } t \leq 0 \\ A & \text{if } 0 < t < 1 \\ \emptyset & \text{if } t \geq 1. \end{cases}$$

\square

【定义(几乎处处)】 设 $E \subset \mathbb{R}^d$, $P(x)$ 是一个与 x 有关的性质. 若集合

$$Z := \{x \in E \mid P(x) \text{ 不成立}\} \text{ 满足 } m(Z) = 0$$

(注意这等价于 $m^*(Z) = 0$), 则称 $P(x)$ 在 E 上 m -几乎处处成立, 简称为几乎处处成立, 也简记为 $P(x)$ a.e. $x \in E$ 或 P a.e. 于 E 或 P a.e.. 这里 a.e. = almost everywhere. \square

【强调】 以后学习其他测度时同学们会明白“几乎处处”是由所考虑的测度决定的. 例如对于 \mathbb{R}^d 上的两个测度 m, \bar{m} , 性质 $P(x)$ 关于测度 m 几乎处处成立, 但关于测度 \bar{m} 就未必几乎处处成立. 目前我们只涉及Lebesgue 测度 m , 所以(除非特别说明)下面说到的“几乎处处”都是关于 L -测度 m 的。

常用的几个“几乎处处”如下: [再次提醒: $m(Z) = 0 \iff m^*(Z) = 0$.]

• **几乎处处有限:** 设 $f : E \subset \mathbb{R}^d \rightarrow [-\infty, +\infty]$. 若

$$m(E(|f| = +\infty)) = 0$$

则称 f 在 E 上几乎处处有限, 记为 $|f| < \infty$ a.e. 于 E .

• **几乎处处相等:** 设 $f, g: E \subset \mathbb{R}^d \rightarrow [-\infty, +\infty]$. 若

$$m(E(f \neq g)) = 0$$

则称 f 与 g 在 E 上几乎处处相等, 记为 $f = g$ a.e. 于 E .

• **几乎处处收敛:** 设 f_k, f 是 $E \subset \mathbb{R}^d$ 上的广义实值函数($k = 1, 2, 3, \dots$). 若

$$m(E(f_k \not\rightarrow f)) = 0$$

其中 $E(f_k \not\rightarrow f) = \{x \in E \mid f_k(x) \not\rightarrow f(x) (k \rightarrow \infty)\}$, 则称 $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 在 E 上几乎处处收敛于 f , 记做

$$\lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = f(x) \text{ a.e. } x \in E \quad \text{或} \quad f_k \rightarrow f (k \rightarrow \infty) \text{ a.e. 于 } E.$$

• **几乎处处连续:** 设 $E \subset \mathbb{R}^d$, 映射 $\varphi: E \rightarrow \mathbb{R}^k$ 满足

$$m(\{x \in E \mid \varphi \text{ 在 } x \text{ 不连续}\}) = 0$$

则称 φ 在 E 上几乎处处连续.

• **几乎处处可微:** 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, 映射 $\varphi: \Omega \rightarrow \mathbb{R}^k$ 满足

$$m(\{x \in \Omega \mid \varphi \text{ 在 } x \text{ 不可微}\}) = 0$$

则称 φ 在 Ω 上几乎处处可微.

【注】若 E 本身是零测集, 则因零测集的任何子集都是零测集, 任何性质在零测集上都是“几乎处处成立”的。因此为使问题真正有意义, 应用时就要看前提集合 E 是否具有正测度, 即是否有 $m(E) > 0$.

【命题1.8.2(可测函数基本性质)】 设 $E \in \mathcal{M} = \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.

(a) 若 $m(E) = 0$, 则 E 上的任何函数都是可测函数。

(b) 若 f 在 E 上可测, $A \subset E$ 是可测子集, 则 f 在 A 上可测。

(c) 若 $Z \subset E$ 是零测集, f 在 $E \setminus Z$ 上可测, 则无论 f 在 Z 上是否有定义, 在 Z 上任意定义 f 的值后, f 都在 E 上可测。

(d) 设 $E_k \in \mathcal{M}$, $f : E = \bigcup_{k \geq 1} E_k \rightarrow [-\infty, +\infty]$. 则

f 在 E 上可测 $\iff f$ 在每个 E_k 上可测。

(e) 若 $f, g : E \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 在 E 上几乎处处相等, 则有

f 在 E 上可测 $\iff g$ 在 E 上可测。

特别若 f 在 E 上可测, 则在 E 的任何零测子集上修改 f 的值不改变 f 在 E 上的可测性。

(f) 设 I, J 为 \mathbb{R} 中的开集, $\Phi : I \times J \rightarrow \mathbb{R}$ 连续。设 $f : E \rightarrow I, g : E \rightarrow J$ 都可测, 则 $x \mapsto \Phi(f(x), g(x))$ 在 E 上可测。

特别分别取 $\Phi(u, v) = \alpha u + \beta v, |u|, uv, u/v$ 和 $I = \mathbb{R}, J = \mathbb{R}$ 以及 $J = \mathbb{R} \setminus \{0\}$, 其中 α, β 为常数, 则可知当 $f, g : E \rightarrow \mathbb{R}$ 可测时, $\alpha f + \beta g, |f|, fg$ 都在 E 上可测。又若 $g : E \rightarrow \mathbb{R} \setminus \{0\}$ 可测, 则 f/g 在 E 上可测。

(g) 若 $f(x) = c \in [-\infty, +\infty]$ (广义常数), 则 f 在 E 上可测。

(h) 若 $f, g : E \rightarrow [0, +\infty]$ 可测, 则 $f + g$ 在 E 上可测。

一般地, 若 $f, g : E \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 可测且 $E(f = +\infty) \cap E(g = -\infty)$ 和

$E(f = -\infty) \cap E(g = +\infty)$ 都是零测集, 则 $f + g$ 在 E 上可测。

(i) 若 $f, g : E \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 可测, 则乘积 fg 在 E 上可测。

(j) 若 $f, g : E \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 且 $0 < |g(x)| < \infty$ a.e. 于 $x \in E$, 则 f/g 在 E 上可测。

(k) 若 $f, g : E \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 为可测函数, 则 $E(f > g) \in \mathcal{M}, E(f \neq g) \in \mathcal{M}$ 。

【证】以下证明中多次用到零测集是 L -可测集(即属于 \mathcal{M}), 零测集的子集是零测集。

(a): 这是因为对任意 $t \in \mathbb{R}$, $E(f > t)$ 都是零测集从而是可测集。

(b): 这是因为 $A(f > t) = E(f > t) \cap A$ 。

(c): 若 f 在 Z 上无定义, 则随意定义其值, 例如定义 $f(x) = 0, x \in Z$. 则对任意 $t \in \mathbb{R}$, $Z(f > t)$ 都是零测集从而是可测集, 因此 $E(f > t) = (E \setminus Z)(f > t) \cup Z(f > t)$ 是可测集。

(d): 这是下面等式的推论:

$$E_k(f > t) = E(f > t) \cap E_k, \quad E(f > t) = \bigcup_{k \geq 1} E_k(f > t).$$

(e): 令 $E_1 = E(f \neq g)$, $E_2 = E \setminus E_1 = E(fg)$. 则 E_1 是零测集从而是可测集, 因而 E_2 是可测集. f, g 当然都在零测集 E_1 上可测. 于是结合 $f|_{E_2} = g|_{E_2}$ 即知: f 在 E 上可测 $\iff f$ 在 E_2 上可测 $\iff g$ 在 E_2 上可测 $\iff g$ 在 E 上可测.

(f): 对任意 $t \in \mathbb{R}$, 若 $E(\Phi(f, g) > t)$ 为空集, 则 $E(\Phi(f, g) > t)$ 可测. 设 $E(\Phi(f, g) > t)$ 非空. 则由 $\Phi: I \times J \rightarrow \mathbb{R}$ 连续和 $I \times J$ 是开集 知 $(I \times J)(\Phi > t) = \Phi^{-1}((t, +\infty))$ 是 \mathbb{R}^2 的非空开集. 据开集的方体分解有

$$\{(u, v) \in I \times J \mid \Phi(u, v) > t\} = \bigcup_{k=1}^{\infty} [a_k, b_k) \times [c_k, d_k).$$

易见对任意 $x \in E$ 有:

$$\begin{aligned} \Phi(f(x), g(x)) > t &\iff (f(x), g(x)) \in \bigcup_{k=1}^{\infty} [a_k, b_k) \times [c_k, d_k) \\ &\iff \exists k \in \mathbb{N} \text{ s.t. } f(x) \in [a_k, b_k), g(x) \in [c_k, d_k) \\ &\iff \exists k \in \mathbb{N} \text{ s.t. } x \in E(f \in [a_k, b_k)) \cap E(g \in [c_k, d_k)) \\ &\iff x \in \bigcup_{k=1}^{\infty} E(f \in [a_k, b_k)) \cap E(g \in [c_k, d_k)). \end{aligned}$$

这就证明了

$$E(\Phi(f, g) > t) = \bigcup_{k=1}^{\infty} E(f \in [a_k, b_k)) \cap E(g \in [c_k, d_k)).$$

因 $E(f \in [a_k, b_k))$, $E(g \in [c_k, d_k))$ 都是可测集, 所以 $E(\Phi(f, g) > t)$ 是可测集. 所以 $x \mapsto \Phi(f(x), g(x))$ 在 E 上可测.

(g): 这是因为对任意 $t \in \mathbb{R}$ 有

$$E(f > t) = \emptyset \in \mathcal{M} \text{ 当 } t \geq c \text{ 时, } E(f > t) = E \in \mathcal{M} \text{ 当 } t < c \text{ 时.}$$

(h): 设 $f, g: E \rightarrow [0, +\infty]$ 可测且 $E(f = +\infty) \cap E(g = -\infty)$ 和 $E(f = -\infty) \cap E(g = +\infty)$ 都是零测集. 来证明 $f + g$ 在 E 上可测. 令

$$\begin{aligned} E_1 &= [E(f = +\infty) \cap E(g = -\infty)] \cup [E(f = -\infty) \cap E(g = +\infty)], \\ E_2 &= [E(f = +\infty) \cap E(-\infty < g \leq +\infty)] \cup [E(-\infty < f \leq +\infty) \cap E(g = +\infty)], \\ E_3 &= [E(f = -\infty) \cap E(-\infty \leq g < \infty)] \cup [E(-\infty \leq f < \infty) \cap E(g = -\infty)], \\ E_4 &= E(|f| < \infty) \cap E(|g| < \infty). \end{aligned}$$

则 $E = E_1 \cup E_2 \cup E_3 \cup E_4$ 且 E_1, E_2, E_3, E_4 都是可测集, $m(E_1) = 0$, 而 $f + g$ 在 E_2, E_3 上分别是广义常数 $+\infty, -\infty$, 因此 $f + g$ 分别在 E_2, E_3 上可测. 又由 (f) 知 $f + g$ 在 E_4 上可测, 所以 $f + g$ 分别在 E_1, E_2, E_3, E_4 上可测. 所以 $f + g$ 在 E 上可测.

(i): 考虑分解 $E = E_1 \cup E_2 \cup E_3 \cup E_4$ 其中

$$\begin{aligned} E_1 &= E(fg = +\infty), \quad E_2 = E(fg = -\infty), \quad E_3 = E(fg = 0) \\ E_4 &= E(0 < |fg| < \infty) = E(0 < |f| < \infty) \cap E(0 < |g| < \infty). \end{aligned}$$

则 E_1, E_2, E_3, E_4 都是可测集, fg 在 E_1, E_2, E_3 上分别是广义常数 $+\infty, -\infty, 0$, 因此 fg 分别在 E_1, E_2, E_3 上可测. 又由 (f) 知 fg 在 E_4 上可测, 所以 fg 分别在 E_1, E_2, E_3, E_4 上可测. 所以 fg 在 E 上可测.

(j): 考虑分解 $E = E_1 \cup E_2 \cup E_3 \cup E_4$ 其中

$$\begin{aligned} E_1 &= E(g = 0) \cup E(|g| = +\infty) \\ E_2 &= [E(f = +\infty) \cap E(0 < g < \infty)] \cup [E(f = -\infty) \cap E(-\infty < g < 0)], \\ E_3 &= [E(f = +\infty) \cap E(-\infty < g < 0)] \cup [E(f = -\infty) \cap E(0 < g < \infty)], \\ E_4 &= E(|f| < \infty) \cap E(0 < |g| < \infty). \end{aligned}$$

则 E_1, E_2, E_3, E_4 都是可测集, $m(E_1) = 0$, f/g 在 E_2, E_3 上分别是广义常数 $+\infty, -\infty$, 因此 f/g 分别在 E_2, E_3 上可测. 又由 (f) 知 f/g 在 E_4 上可测, 所以 f/g 分别在 E_1, E_2, E_3, E_4 上可测. 所以 f/g 在 E 上可测.

(k): 写 $\mathbb{Q} = \{r_k\}_{k=1}^{\infty}$ (全体有理数). 由有理数的稠密性易见

$$E(f > g) = \bigcup_{k=1}^{\infty} E(f > r_k) \cap E(g < r_k) \in \mathcal{M}.$$

由此还知 $E(f \neq g) = E(f > g) \cup E(g > f) \in \mathcal{M}$. \square

• 极限函数的可测性

【命题1.8.3】 $E \in \mathcal{M} = \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 是 E 上的一列广义实值可测函数. 则

$$(a) \text{ 上极限函数 } \limsup_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = \lim_{k \rightarrow \infty} (\sup_{j \geq k} f_j(x)) = \inf_{k \geq 1} (\sup_{j \geq k} f_k(x)), \quad x \in E,$$

$$\text{下极限函数 } \liminf_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = \lim_{k \rightarrow \infty} (\inf_{j \geq k} f_j(x)) = \sup_{k \geq 1} (\inf_{j \geq k} f_k(x)), \quad x \in E$$

都是 E 上的可测函数.

(b) 若 $\lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = f(x) \quad \forall x \in E$, 则极限函数 f 在 E 上可测.

(c) 若 $\lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = f(x) \quad \text{a.e. } x \in E$, 则极限函数 f 在 E 上可测.

【证】(a): 令

$$F_k(x) = \sup_{j \geq k} f_j(x), \quad G_k(x) = \inf_{j \geq k} f_j(x).$$

容易验证对任意 $t \in \mathbb{R}$

$$E(F_k \leq t) = \bigcap_{j=k}^{\infty} E(f_j \leq t) \in \mathcal{M}, \quad E(G_k \geq t) = \bigcap_{j=k}^{\infty} E(f_j \geq t) \in \mathcal{M}.$$

因此 F_k, G_k 都在 E 上可测($k = 1, 2, 3, \dots$). 于是对任意 $t \in \mathbb{R}$ 有

$$E(\inf_{k \geq 1} F_k \geq t) = \bigcap_{k=1}^{\infty} E(F_k \geq t) \in \mathcal{M}, \quad E(\sup_{k \geq 1} G_k \leq t) = \bigcap_{k=1}^{\infty} E(G_k \leq t) \in \mathcal{M}.$$

所以上极限函数 $\limsup_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = \inf_{k \geq 1} F_k(x)$ 和下极限函数 $\liminf_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = \sup_{k \geq 1} G_k(x)$ 都在 E 上可测.

(b): 此时有

$$f(x) = \lim_{n \rightarrow \infty} f_n(x) = \limsup_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = \liminf_{k \rightarrow \infty} f_k(x) \quad \forall x \in E$$

所以 f 在 E 上可测.

(c): 令

$$Z = \{x \in E \mid f_k(x) \not\rightarrow f(x) \ (k \rightarrow \infty)\}.$$

则 $m(Z) = 0$ 因此 Z 是可测集, 从而 $E \setminus Z$ 是可测集. 因 Z 是零测集, 故 f 在 Z 上可测, 而由(b)知 f 在 $E \setminus Z$ 上可测. 所以 f 在 $E = Z \cup (E \setminus Z)$ 上可测. \square

• 连续函数和复合函数的可测性

【命题1.8.4】设 $E \in \mathcal{M} = \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 则有:

(a) 若 $f: E \rightarrow \mathbb{R}$ 几乎处处连续, 则 f 在 E 上可测.

(b) 若 $f: E \rightarrow \mathbb{R}$ 可测且 $f(E) \subset I$ 其中 I 是一个区间, 又设 $g: I \rightarrow \mathbb{R}$ 连续,

则复合函数 $x \mapsto g(f(x))$ 在 E 上可测.

【证】(a): 由假设知存在零测集 $Z \subset E$ 使得 $E \setminus Z$ 中每一点都是 f 在 E 上的连续点。这蕴含 f 在 $E \setminus Z$ 上连续, 也即限制在 $E \setminus Z$ 上, f 在 $E \setminus Z$ 上连续。² 据前面的例子知 f 在 $E \setminus Z$ 上可测。因零测集上的任何函数都是可测函数, 故 f 在 Z 上可测。因此 f 在 $E = (E \setminus Z) \cup Z$ 上可测。

(b): 对任意 $t \in \mathbb{R}$, 由 g 连续和前面例题知存在开集 $U_t \subset \mathbb{R}$ 使得

$$B_t := I(g > t) = U_t \cap I.$$

因区间 I 和开集 U_t 都是 Borel 集, 故它们的交集 B_t 也是 Borel 集。于是由

$$E(g \circ f > t) = E(g \circ f \in (t, +\infty)) = E(f \in g^{-1}((t, +\infty))) = E(f \in B_t)$$

和可测函数性质(命题1.8.1之(c)) 知 $E(g \circ f > t) = E(f \in B_t)$ 是可测集。所以复合函数 $g \circ f$ 在 E 上可测。 \square

【命题1.8.5(C^1 变换保持可测性)】 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, $\varphi: \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 为 C^1 类的单射且 $\det \varphi'(t) \neq 0$ for all $t \in \Omega$. 设 $f: \varphi(\Omega) \rightarrow [-\infty, +\infty]$. 则有

$$y \mapsto f(y) \text{ 在 } \varphi(\Omega) \text{ 上可测} \iff \text{复合函数 } x \mapsto f(\varphi(x)) \text{ 在 } \Omega \text{ 上可测}.$$

【证】 先证明对任意 $t \in \mathbb{R}$ 有等式:

$$\varphi(\Omega)(f > t) = \varphi(\Omega(f \circ \varphi > t)), \quad \Omega(f \circ \varphi > t) = \varphi^{-1}(\varphi(\Omega)(f > t)). \quad (1.8.2)$$

事实上对任意 $y \in \varphi(\Omega)$ 有

$$\begin{aligned} y \in \varphi(\Omega)(f > t) &\iff t < f(y) = f \circ \varphi(\varphi^{-1}(y)) \iff \varphi^{-1}(y) \in \Omega(f \circ \varphi > t) \\ &\iff y = \varphi(\varphi^{-1}(y)) \in \varphi(\Omega(f \circ \varphi > t)). \end{aligned}$$

所以(1.8.2)中第一个等式成立. 又对任意 $x \in \Omega$ 有

$$\begin{aligned} x \in \Omega(f \circ \varphi > t) &\iff f(\varphi(x)) > t \iff \varphi(x) \in \varphi(\Omega(f > t)) \\ &\iff x \in \varphi^{-1}(\varphi(\Omega(f > t))). \end{aligned}$$

²注意: 设 $f: E \rightarrow \mathbb{R}$, $A \subset E$. 则 “ A 中每一点都是 f 在 E 上的连续点” 与 “限制在 A 上 f 在 A 上连续” 是两个不同的概念, 前者蕴含后者, 后者远非前者。例如设 $f(x) = 1$ 当 $x \in \mathbb{Q}$ 时, $f(x) \leq 1/2$ 当 $x \in \mathbb{R} \setminus \mathbb{Q}$ 时。则限制在 \mathbb{Q} 上 f 为常数1, 因此限制在 \mathbb{Q} 上 f 在 \mathbb{Q} 上连续。但 \mathbb{Q} 中每一点都不是 f 在 \mathbb{R} 上的连续点 因为 f 在 \mathbb{R} 上没有连续点。

所以(1.8.2)中第二个等式成立.

由假设条件和反函数定理知 $\varphi(\Omega)$ 是 \mathbb{R}^d 的开集且逆映射 $\varphi^{-1} : \varphi(\Omega) \rightarrow \Omega$ 也是 C^1 的. 因此由**定理1.5.2**知, φ 把 Ω 中的可测集映为可测集, φ^{-1} 把 $\varphi(\Omega)$ 中的可测集映为可测集. 于是由(1.8.2) 知对任意 $t \in \mathbb{R}$ 有

$$\varphi(\Omega)(f > t) \text{ 可测} \iff D(f \circ \varphi > t) \text{ 可测}.$$

所以 f 在 $\varphi(\Omega)$ 上可测 \iff 复合函数 $f \circ \varphi$ 在 Ω 上可测. \square

【例】

(1). 设 $A \in \mathbb{R}^{d \times d}$ 为可逆矩阵, $h \in \mathbb{R}^d$. 则仿线性变换 $x \mapsto Ax + h$ 是从 \mathbb{R}^d 到 \mathbb{R}^d 的光滑同胚, 因此对任一函数 $f : \mathbb{R}^d \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 有:

$$f \text{ 在 } \mathbb{R}^d \text{ 上可测} \iff x \mapsto f(Ax + h) \text{ 在 } \mathbb{R}^d \text{ 上可测}.$$

(2). 设 $f : \mathbb{R}^{2d} = \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d \rightarrow [-\infty, +\infty]$. 则有:

$$f \text{ 在 } \mathbb{R}^{2d} \text{ 上可测} \iff \text{函数}(x, y) \mapsto f(x - y, y) \text{ 在 } \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d = \mathbb{R}^{2d} \text{ 上可测}.$$

事实上如令 $I \in \mathbb{R}^{d \times d}$ 为单位阵, 并令

$$A = \begin{pmatrix} I & -I \\ 0 & I \end{pmatrix}$$

则按列向量表示 $\mathbf{x} = (x, y)^T$ 有 $A\mathbf{x} = (x - y, y)^T$. 因此如果我们用行向量和列向量表示同一函数的自变量, 就有 $f(x - y, y) = f(A\mathbf{x})$. 因 $A \in \mathbb{R}^{2d \times 2d}$ 可逆, 故由本题(1)知: f 在 \mathbb{R}^{2d} 上可测 $\iff \mathbf{x} \mapsto f(A\mathbf{x})$ 在 \mathbb{R}^{2d} 上可测. \square

• 可测函数的延拓

把一个可测函数保持可测性地延拓至全空间 \mathbb{R}^d 有助于对问题的研究. 由于可测性是最容易满足的要求, 保测延拓的方式几乎可以随心所欲.

设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f : E \subset \mathbb{R}^d \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 是可测函数. 任取可测函数 $g : E^c \rightarrow \mathbb{R}$ (例如 $g(x) \equiv 0$). 令

$$F(x) = \begin{cases} f(x) & \text{if } x \in E \\ g(x) & \text{if } x \in E^c(x). \end{cases}$$

则 $F: \mathbb{R}^d \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 在 \mathbb{R}^d 上可测。这是因为 $\mathbb{R}^d = E \cup E^c$ 且 F 分别在 E, E^c 上可测, 所以 F 在 \mathbb{R}^d 上可测。

当我们取 $g(x) \equiv 0$ 时, 相应的 F 称为 f 的 **零延拓**, 它可写成

$$F(x) = f(x)\mathbf{1}_E(x), \quad x \in \mathbb{R}^d.$$

【例】 (1) 设 $f(x)$ 在开区间 (a, b) 内处处可微, 则其导函数 $f'(x)$ 在 (a, b) 上可测。

(2) 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, $f: \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ 在 Ω 上可微. 则对任意 $k \in \{1, 2, \dots, d\}$, 偏导函数 $\frac{\partial f}{\partial x_j}$ 都在 Ω 上可测 ($j = 1, 2, \dots, d$).

【证】 只需证(2). 因可微蕴含连续, 所以 f 在 Ω 上连续从而在 Ω 上可测. 将 f 做零延拓: $f(x) = 0, x \in \Omega^c$. 则延拓后的 f 在 \mathbb{R}^d 上可测. 因此对任意 $h \in \mathbb{R}^d$, 平移 $x \mapsto f(x+h)$ 在 \mathbb{R}^d 上可测. 取 $h = \frac{1}{k}\mathbf{e}_j$, 令

$$f_k(x) = \frac{f(x + \frac{1}{k}\mathbf{e}_j) - f(x)}{\frac{1}{k}}, \quad x \in \mathbb{R}^d, \quad k \in \mathbb{N}$$

则 f_k 在 \mathbb{R}^d 上可测(从而在 Ω 上可测) 且有

$$\frac{\partial f(x)}{\partial x_j} = \lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x), \quad x \in \Omega.$$

因可测函数列的极限函数还是可测函数, 故 $\frac{\partial f}{\partial x_j}$ 在 Ω 上可测. \square

• 简单函数逼近

简单函数主要用于研究可测函数的结构和建立积分。

【定义(简单函数)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 若可测函数 $f: E \rightarrow \mathbb{R}$ 的值域 $f(E)$ 是有限集, 则称 f 是一个简单可测函数, 简称简单函数. \square .

【命题1.8.6】 设 $E \in \mathcal{M} = \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 则

(a) 函数 $f: E \rightarrow \mathbb{R}$ 是简单函数的充分必要条件是 f 可表示为 E 的可测子集的特征函数的有限线性组合:

$$f(x) = \sum_{k=1}^N c_k \mathbf{1}_{E_k}(x), \quad x \in E \quad (1.8.3)$$

其中 $E_k \in \mathcal{M}, E_k \subset E; c_k \in \mathbb{R}$ 为常数, $k = 1, 2, \dots, N$.

(b) 若 f, g 都是 E 上的简单函数, $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$ 为常数, 则 $\alpha f + \beta g$ 和 fg 都是 E 上的简单函数.

【证】(a): 设 f 为是 E 上的简单函数. 由定义, f 的值域 $f(E) = \{c_1, c_2, \dots, c_N\}$ 为有限集, 其中 c_k 互不相同. 令 $E_k = E(f = c_k)$, $k = 1, 2, \dots, N$. 则得

$$f(x) = \sum_{k=1}^N c_k \mathbf{1}_{E_k}(x), \quad x \in E.$$

反之设 f 可表示为 (1.8.3) 的形式. 则 f 是 E 上的可测函数并且 f 的值域含于由数 c_1, c_2, \dots, c_N 和这些数的每一组的和所组成的有限数集, 其互不相同的元素个数不超过 $\sum_{k=1}^N C_N^k = 2^N - 1$. 因此 f 的值域为有限集. 所以 f 是 E 上的简单函数.

(b): 这是因为函数 $\alpha f + \beta g$ 和 fg 都是 E 上的可测函数且它们的值域 $(\alpha f + \beta g)(E)$ 和 $(fg)(E)$ 也都是有限集. \square

下面学习如何用简单函数列逼近一般可测函数. 这需要一个引理——

【引理1.8.7(恒等函数的阶梯函数逼近)】在广义区间 $[0, +\infty]$ 上做阶梯函数列如下:

$$\begin{aligned} \varphi_0(t) &\equiv 0, \\ \varphi_k(t) &= \sum_{j=1}^{k2^k} \frac{j-1}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})}(t) + k \mathbf{1}_{[k, +\infty)}(t), \quad t \in [0, +\infty]. \quad (k = 1, 2, 3, \dots) \end{aligned}$$

则有

$$0 = \varphi_0(t) \leq \varphi_1(t) \leq \varphi_2(t) \leq \varphi_3(t) \leq \dots \leq t; \quad \lim_{k \rightarrow \infty} \varphi_k(t) = t \quad \forall t \in [0, +\infty]$$

并在 $[0, +\infty)$ 有收敛速度估计:

$$|\varphi_k(t) - t| \leq \frac{1}{2^k} \quad \forall t \in [0, +\infty), \quad \forall k > t. \quad (1.8.4)$$

此外有级数表示:

$$t = \sum_{k=1}^{\infty} c_k \mathbf{1}_{I_k}(t), \quad t \in [0, +\infty] \quad (1.8.5)$$

其中 I_k 是 $(0, +\infty]$ 中的区间, $0 < c_k < \infty$, $k = 1, 2, 3, \dots$

【证】为证单调关系 $\varphi_{k-1} \leq \varphi_k$ 可设 $k \geq 2$. 略去自变量只看函数关系, 可写

$$\varphi_k = \sum_{j=1}^{k2^k} \frac{j-1}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})} + k \mathbf{1}_{[k, +\infty)}$$

$$= \sum_{j=1}^{(k-1)2^k} \frac{j-1}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})} + \sum_{j=(k-1)2^k+1}^{k2^k} \frac{j-1}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})} + k \mathbf{1}_{[k, +\infty)},$$

对右端第一项, 按 j 为奇数和偶数求和, 并用特征函数性质

$$\mathbf{1}_{[\frac{2j-2}{2^k}, \frac{2j-1}{2^k})} + \mathbf{1}_{[\frac{2j-1}{2^k}, \frac{2j}{2^k})} = \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^{k-1}}, \frac{j}{2^{k-1}})}$$

有

$$\begin{aligned} \sum_{j=1}^{(k-1)2^k} \frac{j-1}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})} &= \sum_{j=1}^{(k-1)2^{k-1}} \frac{2j-2}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{2j-2}{2^k}, \frac{2j-1}{2^k})} + \sum_{j=1}^{(k-1)2^{k-1}} \frac{2j-1}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{2j-1}{2^k}, \frac{2j}{2^k})} \\ &= \sum_{j=1}^{(k-1)2^{k-1}} \frac{j-1}{2^{k-1}} \mathbf{1}_{[\frac{2j-2}{2^k}, \frac{2j-1}{2^k})} + \sum_{j=1}^{(k-1)2^{k-1}} \frac{j-1}{2^{k-1}} \mathbf{1}_{[\frac{2j-1}{2^k}, \frac{2j}{2^k})} + \sum_{j=1}^{(k-1)2^{k-1}} \frac{1}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{2j-1}{2^k}, \frac{2j}{2^k})} \\ &= \sum_{j=1}^{(k-1)2^{k-1}} \frac{j-1}{2^{k-1}} \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^{k-1}}, \frac{j}{2^{k-1}})} + \sum_{j=1}^{(k-1)2^{k-1}} \frac{1}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{2j-1}{2^k}, \frac{2j}{2^k})}. \end{aligned}$$

对其余两项有

$$\begin{aligned} &\sum_{j=(k-1)2^k+1}^{k2^k} \frac{j-1}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})} + k \mathbf{1}_{[k, +\infty)} \\ &= (k-1) \left(\sum_{j=(k-1)2^k+1}^{k2^k} \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})} + \mathbf{1}_{[k, +\infty)} \right) + \sum_{j=(k-1)2^k+1}^{k2^k} \left(\frac{j-1}{2^k} - (k-1) \right) \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})} + \mathbf{1}_{[k, +\infty)} \\ &= (k-1) \mathbf{1}_{[k-1, +\infty)} + \sum_{j=(k-1)2^k+2}^{k2^k} \left(\frac{j-1}{2^k} - (k-1) \right) \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})} + \mathbf{1}_{[k, +\infty)}. \end{aligned}$$

因此

$$\varphi_k - \varphi_{k-1} = \sum_{j=1}^{(k-1)2^{k-1}} \frac{1}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{2j-1}{2^k}, \frac{2j}{2^k})} + \sum_{j=(k-1)2^k+2}^{k2^k} \frac{j-1-(k-1)2^k}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})} + \mathbf{1}_{[k, +\infty)} \geq 0. \quad (1.8.6)$$

所以 φ_k 关于 k 是递增的.

证收敛性: $\forall t \in [0, +\infty]$, 若 $t < \infty$, 则当 $k > t$ 时存在唯一 $j \in \{1, 2, \dots, k2^k\}$ 使得 $t \in [\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})$ 从而有 $t \geq \varphi_k(t) = \frac{j-1}{2^k} > t - \frac{1}{2^k}$, 因此若 $0 \leq t < \infty$ 则有

$$0 \leq t - \varphi_k(t) \leq \frac{1}{2^k} \quad \forall k > t.$$

若 $t = +\infty$, 则 $\varphi_k(t) = k$ ($k = 1, 2, \dots$). 总之有 $\lim_{k \rightarrow \infty} \varphi_k(t) = t \quad \forall t \in [0, +\infty]$.

最后证明级数表示 (1.8.5). 注意 $\varphi_0(t) \equiv 0$. 由收敛性和 $\varphi_k(t) - \varphi_{k-1}(t) \geq 0$ (见 (1.8.6)) 以及正项级数定义得

$$t = \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{k=1}^n (\varphi_k(t) - \varphi_{k-1}(t)) = \sum_{k=1}^{\infty} (\varphi_k(t) - \varphi_{k-1}(t)), \quad t \in [0, +\infty].$$

而由 (1.8.6) 和 $\varphi_0(t) \equiv 0$ 可写

$$\varphi_k(t) - \varphi_{k-1}(t) = \sum_{j=1}^{n_k} c_{k,j} \mathbf{1}_{I_{k,j}}(t), \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

其中 $I_{k,j}$ 是 $(0, +\infty]$ 中的区间, $n_k \in \mathbb{N}, 0 < c_{k,j} < \infty$. 将可数集 $\{c_{k,j} \mathbf{1}_{I_{k,j}} \mid j = 1, 2, \dots, N_k; k = 0, 1, 2, \dots\}$ 排列成 $\{c_1 \mathbf{1}_{I_1}, c_2 \mathbf{1}_{I_2}, c_3 \mathbf{1}_{I_3}, \dots\}$ 并根据正项级数的和与求和顺序无关就得到 (1.8.5). \square

【定理1.8.8(简单函数逼近和级数表示)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 则

(a) 对任一非负可测函数 $f: E \rightarrow [0, +\infty]$, 存在一列非负简单函数 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 满足

$$0 \leq f_1(x) \leq f_2(x) \leq f_3(x) \leq \dots \leq f(x); \quad \lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = f(x) \quad \forall x \in E.$$

此外存在存在一列常数 $0 < c_k < \infty$ 和可测集 $E_k \subset E$ ($k = 1, 2, 3, \dots$) 使得

$$f(x) = \sum_{k=1}^{\infty} c_k \mathbf{1}_{E_k}(x) \quad \forall x \in E. \quad (1.8.7)$$

(b) 对任一可测函数 $f: E \rightarrow [-\infty, +\infty]$, 存在一列简单函数 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 使得

$$|f_k(x)| \leq |f_{k+1}(x)| \leq |f(x)|, \quad k = 1, 2, 3, \dots; \quad \lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = f(x) \quad \forall x \in E.$$

进一步, 若 f 还在 E 上有界, 则还可使得上述简单函数 f_k 在 E 上一致收敛于 f , 即

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \sup_{x \in E} |f_k(x) - f(x)| = 0.$$

【证】 (a): 令

$$E_{k,j} = E\left(\frac{j-1}{2^k} \leq f < \frac{j}{2^k}\right), \quad j = 1, 2, \dots, k2^k; \quad E_k = E(f \geq k).$$

则有

$$\mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})}(f(x)) = \mathbf{1}_{E_{k,j}}(x), \quad \mathbf{1}_{[k, +\infty)}(f(x)) = \mathbf{1}_{E_k}(x).$$

于是在上述引理中取 $t = f(x)$ 便有

$$f_k(x) := \varphi_k(f(x)) = \sum_{j=1}^{k2^k} \frac{j-1}{2^k} \mathbf{1}_{E_{k,j}}(x) + k \mathbf{1}_{E_k}(x), \quad x \in E \quad (k = 1, 2, 3, \dots).$$

由 $\varphi_k(t)$ 的性质易见 $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 满足 (a) 中的要求. 同样在 (1.8.4) 中取 $t = f(x)$ 得到

$$f(x) = \sum_{j=1}^\infty c_j \mathbf{1}_{I_j}(f(x)) = \sum_{k=1}^\infty c_k \mathbf{1}_{E_k}(x), \quad x \in E$$

其中 $E_k = E(f \in I_k) \in \mathcal{M}$. 【注: 若 $f(x) \equiv 0$, 则一切 E_k 都是空集.】

(b): 设 $f: E \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 可测. 考虑 f 的正部 f^+ 和负部 f^- , 即

$$\begin{aligned} f^+(x) &= \max\{f(x), 0\} = \frac{|f(x)| + f(x)}{2} = f(x) \mathbf{1}_{E(f \geq 0)}(x), \\ f^-(x) &= \max\{-f(x), 0\} = \frac{|f(x)| - f(x)}{2} = -f(x) \mathbf{1}_{E(f \leq 0)}(x). \end{aligned}$$

则易见 f^+, f^- 都是 E 上非负可测函数, 且

$$f(x) = f^+(x) - f^-(x), \quad x \in E.$$

因 $f^+(x) \cdot f^-(x) \equiv 0$, 故这里不会出现 “ $\infty - \infty$ ” 的情况. 设 $\{f_k^{(+)}\}_{k=1}^\infty, \{f_k^{(-)}\}_{k=1}^\infty$ 是 (a) 中构造的相应于 f^+, f^- 的非负简单函数列, 即

$$f_k^{(+)}(x) = \varphi_k(f^+(x)), \quad f_k^{(-)}(x) = \varphi_k(f^-(x)), \quad x \in E, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

则有

$$0 \leq f_k^{(\pm)}(x) \leq f_{k+1}^{(\pm)}(x) \leq f^{(\pm)}(x); \quad \lim_{k \rightarrow \infty} f_k^{(\pm)}(x) = f^{(\pm)}(x) \quad \forall x \in E.$$

取 $f_k = f_k^{(+)} - f_k^{(-)}$, 则 f_k 是简单函数且

$$|f_k(x)| = f_k^{(+)}(x) + f_k^{(-)}(x) \leq f_{k+1}^{(+)}(x) + f_{k+1}^{(-)}(x) = |f_{k+1}(x)| \leq f^+(x) + f^-(x) = |f(x)|$$

$x \in E, \quad k = 1, 2, 3, \dots,$

$$\lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = \lim_{k \rightarrow \infty} f_k^{(+)}(x) - \lim_{k \rightarrow \infty} f_k^{(-)}(x) = f^+(x) - f^-(x) = f(x) \quad \forall x \in E.$$

最后设 f 在 E 上有界: 存在 $0 \leq M < \infty$ 使得 $|f(x)| \leq M$ for all $x \in E$. 则由 (1.8.4) 有

$$\begin{aligned} |f_k^{(\pm)}(x) - f^{(\pm)}(x)| &= |\varphi_k(f^{(\pm)}(x)) - f^{(\pm)}(x)| \leq \frac{1}{2^k} \quad \forall x \in E, \quad \forall k > M, \\ \implies |f_k(x) - f(x)| &\leq \frac{2}{2^k} \quad \forall x \in E, \quad \forall k > M. \end{aligned}$$

所以

$$\sup_{x \in E} |f_k(x) - f(x)| \leq \frac{2}{2^k} \rightarrow 0 \quad (k \rightarrow \infty). \quad \square$$

【注】从上面结果我们可以导出小数 $t \in [0, 1)$ 的2-进级数表示(即 $t = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{a_k}{2^k}$, $a_k \in \{0, 1\}$) 的简单函数级数表示: 限制在 $[0, 1)$ 上, 由函数 $\varphi_k(t)$ 的定义知

$$\varphi_0(t) \equiv 0, \quad \varphi_k(t) = \sum_{j=1}^{2^k} \frac{j-1}{2^k} \mathbf{1}_{[\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})}(t), \quad t \in [0, 1).$$

根据上面(1.8.4)有

$$0 \leq \varphi_k(t) - \varphi_{k-1}(t) = \frac{1}{2^k} \sum_{j=1}^{2^{k-1}} \mathbf{1}_{[\frac{2j-1}{2^k}, \frac{2j}{2^k})}(t) = \frac{1}{2^k} \mathbf{1}_{A_k}(t)$$

其中

$$A_k = \sum_{j=1}^{2^{k-1}} \left[\frac{2j-1}{2^k}, \frac{2j}{2^k} \right), \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

这就给出

$$t = \sum_{k=1}^{\infty} 2^{-k} (\varphi_k(t) - \varphi_{k-1}(t)) = \sum_{k=1}^{\infty} 2^{-k} \mathbf{1}_{A_k}(t), \quad t \in [0, 1). \quad (1.8.8)$$

将这一表示应用于可测函数, 我们可以对有界可测函数得到较好的级数表示. 例如设 $0 \leq f < 1$ 于 E . 则在(1.8.8)中取 $t = f(x)$ 并令

$$E_k = E(f \in A_k)$$

便有

$$\mathbf{1}_{A_k}(f(x)) = \mathbf{1}_{E_k}(x), \quad x \in E$$

从而得到 f 的级数表示:

$$f(x) = \sum_{k=1}^{\infty} 2^{-k} \mathbf{1}_{E_k}(x), \quad x \in E. \quad (1.8.9)$$

§1.9. 可测函数列的收敛和Lusin 定理

本节学习三种收敛: 依测度收敛、几乎处处收敛、一致收敛, 以及它们之间的关系。Lusin 定理则进一步说可测函数可以被连续函数依测度逼近。

• 依测度收敛与几乎处处收敛, Riesz 定理

【定义(依测度收敛)】设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 若 f, f_k 都是 E 上几乎处处有限的可测函数且

$$\lim_{k \rightarrow \infty} m(E(|f_k - f| \geq \varepsilon)) = 0 \quad \forall \varepsilon > 0$$

则称 f_k 在 E 上依测度收敛于 f . \square

【注】提醒记号:

$$E(|f_k - f| \geq \varepsilon) = \{x \in E \mid |f_k(x) - f(x)| \geq \varepsilon\}.$$

由于 f, f_k 都是几乎处处有限的, 即

$$Z := E(|f| = \infty) \cup \bigcup_{k=1}^{\infty} E(|f_k| = \infty) \text{ 是零测集}$$

因此减法 $f_k(x) - f(x)$ 在 $E \setminus Z$ 上有意义。这同时说明, 在下面的命题和定理的证明中, 我们可以用 $E \setminus Z$ 代替 E , 也即不失一般性我们可以把“几乎处处”换成“处处”。这一点请同学们记住。

收敛序列联系着Cauchy 列:

【定义(依测度Cauchy列)】设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 是 E 上的几乎处处有限的可测函数列。若

$$\lim_{k \rightarrow \infty, n \rightarrow \infty} m(E(|f_k - f_n| \geq \varepsilon)) = 0 \quad \forall \varepsilon > 0$$

则称 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 是 E 上的依测度Cauchy 列. \square

【命题1.9.1(依测度收敛的Cauchy准则)】设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 是 E 上的可测函数列。则 f_k 在 E 上依测度收敛于某个可测函数 f 的充分必要条件是: $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 是 E 上的依测度Cauchy 列。

【证】必要性: 设 f_k 在 E 上依测度收敛于某个可测函数 f . 则由定义知 f_k, f 都在 E 上几乎处处有限且对任意 $\varepsilon > 0$ 对 $\varepsilon/2 > 0$ 有

$$\lim_{k \rightarrow \infty} m(E(|f_k - f| \geq \varepsilon/2)) = 0.$$

由

$$|f_k(x) - f_n(x)| \leq |f_k(x) - f(x)| + |f(x) - f_n(x)|$$

易见

$$E(|f_k - f_n| \geq \varepsilon) \subset E(|f_k - f| \geq \varepsilon/2) \cup E(|f_n - f| \geq \varepsilon/2)$$

因此

$$0 \leq m(E(|f_k - f_n| \geq \varepsilon)) \leq m(E(|f_k - f| \geq \varepsilon/2)) + m(E(|f_n - f| \geq \varepsilon/2)).$$

所以(有极限的两边夹原理)

$$\lim_{k \rightarrow \infty, n \rightarrow \infty} m(E(|f_k - f_n| \geq \varepsilon)) = \lim_{k \rightarrow \infty} m(E(|f_k - f| \geq \varepsilon/2)) + \lim_{n \rightarrow \infty} m(E(|f_n - f| \geq \varepsilon/2)) = 0.$$

所以 $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 是 E 上的依测度Cauchy 列。

充分性: 设 $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 是 E 上的依测度Cauchy 列。则 f_k 都在 E 上几乎处处有限且

对 $\varepsilon = \frac{1}{2}$, 存在正整数 k_1 使得

$$m(E(|f_k - f_n| \geq \frac{1}{2})) < \frac{1}{2} \quad \forall k, n \geq k_1.$$

对 $\varepsilon = \frac{1}{4}$, 存在正整数 $k_2 > k_1$ 使得

$$m(E(|f_k - f_n| \geq \frac{1}{4})) < \frac{1}{4} \quad \forall k, n \geq k_2.$$

归纳地(用归纳操作手续) 我们得到正整数列 $k_1 < k_2 < k_3 < \dots$ 使得

$$m(E(|f_k - f_n| \geq \frac{1}{2^j})) < \frac{1}{2^j} \quad \forall k, n \geq k_j, \quad j = 1, 2, 3, \dots$$

由此特别有

$$m(E(|f_{k_{j+1}} - f_{k_j}| \geq \frac{1}{2^j})) < \frac{1}{2^j}, \quad j = 1, 2, 3, \dots \quad (1.9.1)$$

由此得到

$$\sum_{j=1}^{\infty} m(E(|f_{k_{j+1}} - f_{k_j}| \geq \frac{1}{2^j})) \leq \sum_{j=1}^{\infty} \frac{1}{2^j} = 1 < \infty.$$

据**Borel-Cantelli 引理** (见Stein & Shakarchi的《实分析》第1章第6节习题16)知

$$Z := \bigcap_{n=1}^{\infty} \bigcup_{j=n}^{\infty} E(|f_{k_{j+1}} - f_{k_j}| \geq \frac{1}{2^j}) \quad \text{是零测集} \quad \text{i.e.} \quad m(Z) = 0.$$

令

$$f(x) = f_{k_1}(x) + \sum_{j=1}^{\infty} (f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)), \quad x \in E \setminus Z. \quad (1.9.2)$$

来证明这个函数级数在 $E \setminus Z$ 上处处绝对收敛, 从而处处收敛于其和函数 $f(x)$. 事实上由de Moregan 对偶律有

$$E \setminus Z = \bigcup_{n=1}^{\infty} \bigcap_{j=n}^{\infty} (E \setminus E_j) = \bigcup_{n=1}^{\infty} \bigcap_{j=n}^{\infty} E(|f_{k_{j+1}} - f_{k_j}| < \frac{1}{2^j})$$

因此对任意 $x \in E \setminus Z$ 存在 $N = N_x \in \mathbb{N}$ 使得 $x \in \bigcap_{j=N}^{\infty} E(|f_{k_{j+1}} - f_{k_j}| < \frac{1}{2^j})$ 即

$$|f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)| < \frac{1}{2^j} \quad \forall j \geq N$$

从而有

$$\begin{aligned} & |f_{k_1}(x)| + \sum_{j=1}^{\infty} |f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)| \\ &= |f_{k_1}(x)| + \sum_{j=1}^N |f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)| + \sum_{j=N+1}^{\infty} |f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)| \\ &\leq |f_{k_1}(x)| + \sum_{j=1}^N |f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)| + \sum_{j=N+1}^{\infty} \frac{1}{2^j} < \infty. \end{aligned}$$

所以函数级数(1.9.2)在 $E \setminus Z$ 上处处绝对收敛。由级数收敛的定义——部分和的极限——得到

$$f(x) = \lim_{j \rightarrow \infty} \left(f_{k_1}(x) + \sum_{j=1}^n (f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)) \right) = \lim_{n \rightarrow \infty} f_{k_n}(x) \quad \forall x \in E \setminus Z.$$

补充定义 $f(x) = 0$ 当 $x \in Z$, 则我们证明了函数子列 $\{f_{k_n}(x)\}_{n=1}^{\infty}$ 在 E 上几乎处处收敛于一个处处有限的可测函数 $f(x)$.

对任意 $\varepsilon > 0$, 取 $N \in \mathbb{N}$ 使得 $\frac{1}{2^N} < \varepsilon/2$. 来证明当 $n > N$ 时有

$$E(|f_{k_n} - f| \geq \varepsilon/2) \subset Z \cup \bigcup_{j=n}^{\infty} E(|f_{k_{j+1}} - f_{k_j}| \geq \frac{1}{2^j}). \quad (1.9.3)$$

等价地只需证明它们各自关于 E 的余集有反向包含关系, 即证明

$$E(|f_{k_n} - f| < \varepsilon/2) \supset (E \setminus Z) \cap \bigcap_{j=n}^{\infty} E(|f_{k_{j+1}} - f_{k_j}| < \frac{1}{2^j}). \quad (1.9.4)$$

事实上对任意 $x \in (E \setminus Z) \cap \bigcap_{j=n}^{\infty} E(|f_{k_{j+1}} - f_{k_j}| < \frac{1}{2^j})$ 有

$$\begin{aligned} f(x) &= f_{k_1}(x) + \sum_{j=1}^{\infty} (f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)) \\ &= f_{k_1}(x) + \sum_{j=1}^{n-1} (f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)) + \sum_{j=n}^{\infty} (f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)) \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
&= f_{k_n}(x) + \sum_{j=n}^{\infty} (f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)) \\
&\implies |f_{k_n}(x) - f(x)| \leq \sum_{j=n}^{\infty} |f_{k_{j+1}}(x) - f_{k_j}(x)| \leq \sum_{j=n}^{\infty} \frac{1}{2^j} = \frac{1}{2^{n-1}} \leq \frac{1}{2^N} < \varepsilon/2
\end{aligned}$$

$\implies x \in E(|f_{k_n} - f| < \varepsilon/2)$. 这就证明了包含关系(1.9.4). 因此(1.9.3) 成立.

于是当 $n > N$ 时由(1.9.3) 和(1.9.1)有

$$m(E(|f_{k_n} - f| \geq \varepsilon/2)) \leq \sum_{j=n}^{\infty} m(E(|f_{k_{j+1}} - f_{k_j}| \geq \frac{1}{2^j})) < \sum_{j=n}^{\infty} \frac{1}{2^j} = \frac{1}{2^{n-1}}.$$

这证明了当 $n \rightarrow \infty$ 时 $m(E(|f_{k_n} - f| \geq \varepsilon/2)) \rightarrow 0$.

最后由 $|f_n(x) - f(x)| \leq |f_n(x) - f_{k_n}(x)| + |f_{k_n}(x) - f(x)|$ 有

$$E(|f_n - f| \geq \varepsilon) \subset E(|f_n - f_{k_n}| \geq \varepsilon/2) \cup E(|f_{k_n} - f| \geq \varepsilon/2)$$

从而有

$$m(E(|f_n - f| \geq \varepsilon)) \leq m(E(|f_n - f_{k_n}| \geq \varepsilon/2)) + m(E(|f_{k_n} - f| \geq \varepsilon/2)) \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty).$$

这就证明了 f_n 在 E 上依测度收敛于某个可测函数 f . \square

【Riesz定理】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, f_k 在 E 上依测度收敛于 f . 则存在 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 的子列 $\{f_{k_j}\}_{j=1}^{\infty}$ 使得 f_{k_j} 在 E 上几乎处处收敛于 f , 即

$$\lim_{j \rightarrow \infty} f_{k_j}(x) = f(x) \quad \text{a.e. } x \in E.$$

【证】 由假设和命题1.9.1(依测度收敛的Cauchy准则)知 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 是 E 上的依测度Cauchy 列, 而在这个命题的充分性证明中我们已证明了存在 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 的子列 $\{f_{k_j}\}_{j=1}^{\infty}$ 和 E 上的几乎处处有限的可测函数 g 使得 f_{k_j} 在 E 上几乎处处收敛于 g , 同时 f_k 在 E 上依测度收敛于 g . 于是对任意 $\varepsilon > 0$ 有

$$E(|f - g| \geq \varepsilon) \subset E(|f - f_k| \geq \varepsilon/2) \cup E(|f_k - g| \geq \varepsilon/2)$$

从而有

$$m(E(|f - g| \geq \varepsilon)) \leq m(E(|f - f_k| \geq \varepsilon/2)) + m(E(|f_k - g| \geq \varepsilon/2)), \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

令 $k \rightarrow \infty$ 得到 $m(E(|f - g| \geq \varepsilon)) = 0$. 因

$$E(|f - g| > 0) = \bigcup_{n=1}^{\infty} E(|f - g| \geq 1/n)$$

故得到

$$m(E(|f - g| > 0)) \leq \sum_{n=1}^{\infty} m(E(|f - g| \geq 1/n)) = 0.$$

所以 $f = g$ a.e. 于 E 从而 f_{k_j} 在 E 上几乎处处收敛于 f . \square

• 几乎处处收敛与近一致收敛, Egorov定理

【Egorov(叶果洛夫)定理】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 测度有限: $m(E) < \infty$. 设 f_k, f 为 E 上的几乎处处有限的可测函数且

$$\lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = f(x) \quad \text{a.e. } x \in E.$$

则 f_k 在 E 上近一致收敛于 f , 即: 对任意 $\varepsilon > 0$ 存在可测集 $E_\varepsilon \subset E$ 使得 $m(E_\varepsilon) < \varepsilon$ 且 f_k 在 $E \setminus E_\varepsilon$ 上一致收敛于 f , 即

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \sup_{x \in E \setminus E_\varepsilon} |f_k(x) - f(x)| = 0.$$

【证】 令

$$Z = E(f_k \not\rightarrow f) \cup E(|f| = \infty) \cup \bigcup_{k=1}^{\infty} E(|f_k| = \infty).$$

则由假设知 $m(Z) = 0$. 以 $E \setminus Z$ 代替 E 我们可以假设 f_k, f 都在 E 上处处有限且 $f_k(x) \rightarrow f(x) (k \rightarrow \infty)$ for all $x \in E$.

对任意 $\delta > 0$, 令

$$E_k(\delta) = E(|f_k - f| \geq \delta) = \{x \in E \mid |f_k(x) - f(x)| \geq \delta\}.$$

来证明

$$\lim_{n \rightarrow \infty} m\left(\bigcup_{k=n}^{\infty} E_k(\delta)\right) = 0.$$

事实上我们有

$$\begin{aligned} m\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k(\delta)\right) &\leq m(E) < \infty, \\ \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k(\delta) &\supset \bigcup_{k=2}^{\infty} E_k(\delta) \supset \bigcup_{k=3}^{\infty} E_k(\delta) \supset \cdots, \quad \bigcap_{n=1}^{\infty} \bigcup_{k=n}^{\infty} E_k(\delta) = \emptyset \end{aligned}$$

这里 “ $= \emptyset$ ” 是因为 $\lim_{k \rightarrow \infty} |f_k(x) - f(x)| = 0$ for all $x \in E$. 据测度的单调极限定理知

$$\lim_{n \rightarrow \infty} m\left(\bigcup_{k=n}^{\infty} E_k(\delta)\right) = m\left(\bigcap_{n=1}^{\infty} \bigcup_{k=n}^{\infty} E_k(\delta)\right) = m(\emptyset) = 0.$$

由此有: 对任意 $\varepsilon > 0$ 和 $j \in \mathbb{N}$ 存在 $n_j \in \mathbb{N}$ 使得

$$m\left(\bigcup_{k=n_j}^{\infty} E_k(1/j)\right) < \frac{\varepsilon}{2^j}.$$

令

$$E_\varepsilon = \bigcup_{j=1}^{\infty} \bigcup_{k=n_j}^{\infty} E_k(1/j).$$

则

$$m(E_\varepsilon) \leq \sum_{j=1}^{\infty} m\left(\bigcup_{k=n_j}^{\infty} E_k(1/j)\right) < \sum_{j=1}^{\infty} \frac{\varepsilon}{2^j} = \varepsilon.$$

来证明 f_k 在 $E \setminus E_\varepsilon$ 上一致收敛于 f . 因

$$E \setminus E_\varepsilon = \bigcap_{j=1}^{\infty} \bigcap_{k=n_j}^{\infty} (E \setminus E_k(1/j)) = \bigcap_{j=1}^{\infty} \bigcap_{k=n_j}^{\infty} E(|f_k - f| < 1/j)$$

故对任意 $j \in \mathbb{N}$, 当 $k \geq n_j$ 时, 对所有 $x \in E \setminus E_\varepsilon$ 有 $|f_k(x) - f(x)| < 1/j$. 因此

$$\sup_{x \in E \setminus E_\varepsilon} |f_k(x) - f(x)| \leq 1/j \quad \forall k \geq n_j.$$

所以, 先令 $k \rightarrow \infty$ 再令 $j \rightarrow \infty$ 即得

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \sup_{x \in E \setminus E_\varepsilon} |f_k(x) - f(x)| = 0.$$

□

• 可测函数与连续函数, Lusin定理

先回忆函数和映射的支集: 设 $Y = [-\infty, +\infty]$ 或 \mathbb{C} 或 \mathbb{R}^l , 对任一函数或映射 $f: \mathbb{R}^d \rightarrow Y$, 称使得 $f(x) \neq 0$ 的 x 的集合的闭包为 f 的承载集或支撑集, 简称支集, 记作 $\text{supp} f$, 即

$$\text{supp} f = \overline{\{x \in \mathbb{R}^d \mid f(x) \neq 0\}}.$$

一般地, 对任一集合 $E \subset \mathbb{R}^d$ 和映射 $f: E \rightarrow Y$, 称闭包 $\text{supp} f = \overline{\{x \in E \mid f(x) \neq 0\}}$ 为 f 在 E 上的支集.

注意: 因闭包是闭集, 故 f 的支集 $\text{supp} f$ 总是闭集. 因此当 f 的定义域 E 为闭集时有 $\text{supp} f \subset E$.

【Lusin定理】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, f 为 E 上的实值或复值可测函数. 则对任意开集 $\Omega \supset E$ 和任意 $\varepsilon > 0$ 存在 $g \in C(\mathbb{R}^d)$ 使得

$$m(E(f \neq g)) < \varepsilon, \quad \sup_{x \in \mathbb{R}^d} |g(x)| \leq \sup_{x \in E} |f(x)| \quad \text{且} \quad \text{supp} g \subset \overline{\Omega}.$$

【证】(参照W. Rudin的Real and Complex Analysis) 任给定开集 $\Omega \supset E$ 和 $\varepsilon > 0$. 分三步进行.

Step 1. 在这一步中假设 f 是实值的. 首先设 $0 \leq f < 1$ 于 E . 此时应用可测函数的级数表示(1.8.9), 存在可测集列 $E_k \subset E$ 使得

$$f(x) = \sum_{k=1}^{\infty} 2^{-k} \mathbf{1}_{E_k}(x), \quad x \in E.$$

根据Lebesgue 测度的正则性, 存在开集 U_k , 闭集 F_k 使得 $F_k \subset E_k \subset U_k$ 且

$m(U_k \setminus F_k) < 2^{-k}\varepsilon$. 以开集 $U_k \cap \Omega$ 代替 U_k 我们可以假定 $U_k \subset \Omega$. 作连续函数

$h_k: \mathbb{R}^d \rightarrow [0, 1]$ 满足 $h_k(x) = 1 \ \forall x \in F_k$ (当 F_k 非空时); $h_k(x) = 0 \ \forall x \in U_k^c$.

例如可以取

$$h_k(x) = \frac{\text{dist}(x, U_k^c)}{\text{dist}(x, F_k) + \text{dist}(x, U_k^c)}, \quad x \in \mathbb{R}^d.$$

[此处约定 $\text{dist}(x, \emptyset) = 1$.] 定义

$$g(x) = \sum_{k=1}^{\infty} 2^{-k} h_k(x), \quad x \in \mathbb{R}^d.$$

显然上式右端的连续项函数级数在 \mathbb{R}^d 上一致收敛, 因此其和函数 g 在 \mathbb{R}^d 上连续; 并且由于当 $x \notin \Omega$ 时, 一切 $h_k(x) = 0$, 从而 $g(x) = 0$, 故 g 的支集含于 Ω 的闭包中, 即 $\text{supp } g \subset \bar{\Omega}$. 不难验证

$$h_k(x) = \mathbf{1}_{E_k}(x) \quad \forall x \notin U_k \setminus F_k \quad (k = 1, 2, 3, \dots).$$

因此如令 $S = \cup_{k=1}^{\infty} (U_k \setminus F_k)$, 则有

$$g(x) = f(x) \quad \forall x \in E \setminus S.$$

从而有 $E(f \neq g) \subset S$,

$$m(E(f \neq g)) \leq m(S) \leq \sum_{k=1}^{\infty} m(U_k \setminus F_k) < \varepsilon.$$

从 $g(x)$ 的定义还得到 $g(x) < 1$ for all $x \in \mathbb{R}^d$. 事实上由 $f(x) < 1$ 于 E 易见 $\cap_{k=1}^{\infty} E_k = \emptyset$ 从而 $\cap_{k=1}^{\infty} F_k = \emptyset$. 于是对任意 $x \in \mathbb{R}^d$, 存在 k 使得 $x \notin F_k$, 从而 $h_k(x) < 1$. 这就蕴含 $g(x) < 1$.

其次设 $|f| < 1$. 令 $f_1 = \frac{|f|+f}{2}, f_2 = \frac{|f|-f}{2}$. 则 $0 \leq f_1, f_2 < 1$. 于是对于 $\varepsilon/2 > 0$, 存在 $g_i \in C(\mathbb{R}^d)$ 满足 $\text{supp } g_i \subset \bar{\Omega}$ 使得 $m(E(f_i \neq g_i)) < \varepsilon/2$ 且 $0 \leq g_i < 1$ 于 \mathbb{R}^d ($i = 1, 2$).

令 $g = g_1 - g_2$. 则 $g \in C(\mathbb{R}^d)$ 且易见 $\text{supp } g \subset \text{supp } g_1 \cup \text{supp } g_2 \subset \overline{\Omega}$. 再由 $f = f_1 - f_2$ 得到

$$E(f \neq g) \subset E(f_1 \neq g_1) \cup E(f_2 \neq g_2) \quad \text{从而}$$

$$m(E(f \neq g)) \leq m(E(f_1 \neq g_1)) + m(E(f_2 \neq g_2)) < \varepsilon/2 + \varepsilon/2 = \varepsilon.$$

此外由 $0 \leq g_1, g_2 < 1$ 易见有 $|g(x)| = |g_1(x) - g_2(x)| < 1 \quad \forall x \in \mathbb{R}^d$.

对于一般情形, 令

$$\tilde{f}(x) = \frac{2}{\pi} \arctan(f(x)), \quad x \in E.$$

则 $|\tilde{f}| < 1$ 于 \mathbb{R}^d . 故存在 $\tilde{g} \in C(\mathbb{R}^d)$ 满足 $\text{supp } \tilde{g} \subset \overline{\Omega}$ 使得 $m(E(\tilde{f} \neq \tilde{g})) < \varepsilon$ 且 $|\tilde{g}| < 1$ 于 \mathbb{R}^d . 取

$$g(x) = \tan\left(\frac{\pi}{2}\tilde{g}(x)\right).$$

则 g 连续, 且由 $g(x) \neq 0 \iff \tilde{g}(x) \neq 0$ 知 $\text{supp } g = \text{supp } \tilde{g} \subset \overline{\Omega}$. 因 $f(x) = \tan(\frac{\pi}{2}\tilde{f}(x))$ 故 $E(f \neq g) = E(\tilde{f} \neq \tilde{g})$. 所以 $m(E(f \neq g)) < \varepsilon$.

Step 2. 设 f 为复值的: $f(x) = f_1(x) + i f_2(x)$ 其中 f_1, f_2 为实值可测函数. 对 $\varepsilon/2 > 0$, 由 **Step 1**, 存在实值 $g_1, g_2 \in C(\mathbb{R}^d)$ 使得 $m(E(f_1 \neq g_1)) < \varepsilon/2$, $m(E(f_2 \neq g_2)) < \varepsilon/2$ 且 $\text{supp } g_1, \text{supp } g_2 \subset \overline{\Omega}$. 令 $g(x) = g_1(x) + i g_2(x)$. 则 $g \in C(\mathbb{R}^d)$ 且易见 $\text{supp } g \subset \text{supp } g_1 \cup \text{supp } g_2 \subset \overline{\Omega}$, $E(f \neq g) \subset E(f_1 \neq g_1) \cup E(f_2 \neq g_2)$, 因此

$$m(E(f \neq g)) \leq m(E(f_1 \neq g_1)) + m(E(f_2 \neq g_2)) < \varepsilon/2 + \varepsilon/2 = \varepsilon.$$

Step 3. 设 f 为复值的, $g \in C(\mathbb{R}^d)$ 是 **Step 2** 中对一般情形得到的复值连续函数. 记 $M = \sup_{x \in E} |f(x)|$. 若 $M = \infty$, 则这个 g 即满足定理中的要求. 下设 $M < \infty$. 考虑复变函数 $\Phi: \mathbb{C} \rightarrow \mathbb{C}$,

$$\Phi(z) = z \quad \text{if } |z| \leq M; \quad \Phi(z) = M \frac{z}{|z|} \quad \text{if } |z| > M.$$

易见 Φ 在 \mathbb{C} 上连续且 $|\Phi(z)| \leq M$ for all $z \in \mathbb{C}$. 由复合函数连续性知 $\Phi \circ g \in C(\mathbb{R}^d)$. 显然 $\sup_{x \in \mathbb{R}^d} |\Phi(g(x))| \leq M$. 因 $\Phi(g(x)) \neq 0$ 蕴含 $g(x) \neq 0$, 故有 $\text{supp } \Phi \circ g \subset \text{supp } g \subset \overline{\Omega}$. 最后由 $|f(x)| \leq M$ 易见 $g(x) = f(x)$ 蕴含 $\Phi(g(x)) = f(x)$. 因此 $E(f \neq \Phi \circ g) \subset E(f \neq g)$,

$$m(E(f \neq \Phi \circ g)) \leq m(E(f \neq g)) < \varepsilon.$$

因此这个连续函数 $\Phi \circ g$ 满足定理中的要求. \square

作业题(2018-3-21)

1. 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f: E \rightarrow [-\infty, +\infty]$. 证明:

f 在 E 上可测 \iff 对任意有理数 r , $E(f > r) \in \mathcal{M}$.

提示: $\forall t \in \mathbb{R}$, 考虑有理数子集 $\{r_k\}_{k=1}^\infty = [t, +\infty) \cap \mathbb{Q}$, 证明 $E(f > t) = \bigcup_{k=1}^\infty E(f > r_k)$.

2. 周民强《实变函数论》(第2版2008年) P127 思考题1,2,3,4; P147 思考题2, 习题3 第一组3 (此题可以用习题课讲的Vitali 覆盖引理证明).

作业题(2018-3-23)

Stein和Shakarchi的《实分析》第1章第6节习题17.

作业题(2018-3-28)

周民强《实变函数论》(第2版2008年, 北大出版社) P140 思考题1, 2,4,5, P144 思考题1, P148 习题3 第一组习题4,5,6,7,8,11,12,14,15,16; 第二组习题9.

第二章 积分理论

§2.1. 非负可测函数的积分

§2.2. 一般可测函数的积分

§2.3. Riemann积分与Lebesgue积分的关系

§2.4. 简单的积分换元公式和Newton-Leibnitz 公式

§2.5. 连续函数逼近, 积分的平均连续性

§2.6. 重积分和累次积分, Fubini定理

§2.7. L^1 -函数的Fourier 变换和Fourier反演公式

§2.8. 积分换元公式

§2.1. 非负可测函数的积分

就像从正项级数开始建立无穷级数理论一样, 积分的建立先从非负函数类开始是方便的, 本身也很重要, 最大好处是: 只涉及加法, 因此不会出现同号无穷大相减: “ $\infty - \infty$ ”.

我们手头已有的工具是集合的测度, 这使我们可以先对简单函数定义积分。首先建立有限数集的求和 对任意数集 $\{a_y \mid y \in A\}$ 满足 $A_0 := \{y \in A \mid a_y \neq 0\}$ 是有限集或空集, 定义

$$\sum_{y \in A} a_y = \sum_{y \in A_0} a_y \quad (*)$$

其中对于 A_0 为空集的情形, 定义空集上的求和恒为零:

$$\sum_{y \in \emptyset} a_y = 0.$$

按此定义易知对任意集合 B 满足 $A_0 \subset B \subset A$ 都有

$$\sum_{y \in A} a_y = \sum_{y \in B} a_y = \sum_{y \in A_0} a_y.$$

事实上若集合 B 满足 $A_0 \subset B \subset A$, 则对于 $B_0 := \{y \in B \mid a_y \neq 0\}$ 有 $B_0 = A_0$. 这是因为若 $y \in B_0$, 则 $y \in B \subset A$ 且 $a_y \neq 0$ 因此 $y \in A_0$ 所以 $B_0 \subset A_0$. 反之若 $y \in A_0$ 则 $a_y \neq 0$ 且由 $A_0 \subset B$ 知 $y \in B$, 所以 $y \in B_0$. 所以 $A_0 \subset B_0$, 所以 $B_0 = A_0$. 于是由有限数集求和

的定义(*)得到

$$\sum_{y \in B} a_y = \sum_{y \in B_0} a_y = \sum_{y \in A_0} a_y = \sum_{y \in A} a_y.$$

【例】 设 f 是 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 上的非负简单函数. 由简单函数的定义知 $f(E)$ 是有限集. 写 $f(E) = \{c_1, c_2, \dots, c_n\}$ 其中 c_k 互不相同. 则有

$$\sum_{y \geq 0} ym(E(f=y)) = \sum_{y \in f(E)} m(E(f=y)) = \sum_{k=1}^n m(E(f=c_k)) = m(E).$$

这里第一个等号用到值域 $f(E) \subset [0, +\infty)$ 是有限集、空集的测度为零, 最后等号用到可加性: $E = \bigcup_{k=1}^n E(f=c_k)$, $E(f=c_k)$ 可测且互不相交. \square

【定义(非负简单函数的积分)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 令 $\mathcal{S}^+(E)$ 为 E 上非负简单函数的全体. 对任意 $f \in \mathcal{S}^+(E)$, 定义 f 在 E 上关于 L -测度 m 的积分为

$$\int_E f(x)dx = \sum_{y \geq 0} ym(E(f=y)) = \sum_{y \in f(E)} ym(E(f=y))$$

它是一个广义非负实数. 这里用到性质: 值域 $f(E)$ 是有限集、空集的测度为零, 从而有 $\{y \in [0, +\infty) \mid ym(E(f=y)) \neq 0\} \subset f(E) \subset [0, +\infty)$. \square

将这一定义应用于常值函数(如分别令 $f(x) \equiv 1$ 于 E 和 $f(x) \equiv a$ 于 E), 其中 $a \geq 0$ 为常数, 则有

$$\int_E dx := \int_E 1dx = m(E), \quad \int_E a dx = am(E).$$

【命题2.1.1(非负简单函数的积分性质)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f, g \in \mathcal{S}^+(E)$. 则有

(a) 可加性: 若 A, B 是 E 的不相交的可测子集, 则

$$\int_{A \cup B} f(x)dx = \int_A f(x)dx + \int_B f(x)dx.$$

一般地, 设 $E_k \subset E$ ($k = 1, 2, \dots$) 为可数个互不相交的可测集. 则

$$\int_{\bigcup_{k \geq 1} E_k} f(x)dx = \sum_{k \geq 1} \int_{E_k} f(x)dx.$$

(b) 线性: 对任意常数 $\alpha, \beta \in [0, +\infty)$ 有

$$\int_E (\alpha f(x) + \beta g(x))dx = \alpha \int_E f(x)dx + \beta \int_E g(x)dx.$$

(c) 单调性: 若 $f \leq g$ 于 E , 则

$$\int_E f(x)dx \leq \int_E g(x)dx.$$

(d) 子集与全集的积分关系: 对任意可测子集 $A \subset E$ 有

$$\int_A f(x)dx = \int_E \mathbf{1}_A(x)f(x)dx.$$

特别有

$$m(A) = \int_E \mathbf{1}_A(x)dx.$$

【证】(a): 直接证可数可加性: 由 $(\bigcup_{k \geq 1} E_k)(f = y) = \bigcup_{k \geq 1} E_k(f = y)$ 和 E_k 互不相交以及非负二重级数可以换序有

$$\begin{aligned} \int_{\bigcup_{k \geq 1} E_k} f(x)dx &= \sum_{y \geq 0} y m\left(\left(\bigcup_{k \geq 1} E_k\right)(f = y)\right) = \sum_{y \geq 0} y \sum_{k \geq 1} m(E_k(f = y)) \\ &= \sum_{k \geq 1} \left(\sum_{y \geq 0} y m(E_k(f = y))\right) = \sum_{k \geq 1} \int_{E_k} f(x)dx. \end{aligned}$$

(b): 只需证明

$$\int_E \alpha f(x)dx = \alpha \int_E f(x)dx, \quad \alpha \text{ 是非负常数.} \quad (2.1.1)$$

$$\int_E (f(x) + g(x))dx = \int_E f(x)dx + \int_E g(x)dx. \quad (2.1.2)$$

当 $\alpha = 0$ 时 (2.1.1) 显然成立。设 $\alpha > 0$. 我们有

$$\begin{aligned} \int_E \alpha f(x)dx &= \sum_{y \geq 0} y m(E(\alpha f = y)) = \alpha \sum_{y \geq 0} \frac{y}{\alpha} m(E(f = \frac{y}{\alpha})) \\ &= \alpha \sum_{y \geq 0} y m(E(f = y)) = \alpha \int_E f(x)dx. \end{aligned}$$

为证 (2.1.2), 先证明当 f 为常数时等式成立。事实上设 $f(x) = a$ for all $x \in E$, 其中 a 是非负常数, 则有

$$\begin{aligned} \int_E (f(x) + g(x))dx &= \int_E (a + g(x))dx = \sum_{y \geq 0} y m(E(a + g = y)) = \sum_{y \geq a} y m(E(g = y - a)) \\ &= \sum_{y \geq 0} (a + y) m(E(g = y)) = a \sum_{y \geq 0} m(E(g = y)) + \sum_{y \geq 0} y m(E(g = y)) \\ &= am(E) + \int_E g(x)dx = \int_E f(x)dx + \int_E g(x)dx. \end{aligned}$$

对于一般情形, 设 $f(E) = \{a_1, a_2, \dots, a_n\}$ 其中 $a_k \geq 0$ 互不相同. 令 $E_k = E(f = a_k)$, 则 E_1, E_2, \dots, E_n 互不相交且 $E = \bigcup_{k=1}^n E_k$. 注意 f 在每个 E_k 上是常数, 于是有可加性和 f 为常数时的结果有

$$\begin{aligned} \int_E (f(x) + g(x)) dx &= \sum_{k=1}^n \int_{E_k} (f(x) + g(x)) dx \\ &= \sum_{k=1}^n \left(\int_{E_k} f(x) dx + \int_{E_k} g(x) dx \right) = \sum_{k=1}^n \int_{E_k} f(x) dx + \sum_{k=1}^n \int_{E_k} g(x) dx \\ &= \int_{\bigcup_{k=1}^n E_k} f(x) dx + \int_{\bigcup_{k=1}^n E_k} g(x) dx = \int_E f(x) dx + \int_E g(x) dx. \end{aligned}$$

(c): 设 $f \leq g$ 于 E . 令 $h(x) = g(x) - f(x)$, 则 h 是 E 上的非负简单函数且 $g = f + h$. 于是由线性质和非负性有

$$\int_E g(x) dx = \int_E f(x) dx + \int_E h(x) dx \geq \int_E f(x) dx.$$

(d): 设 $A \subset E$ 为可测子集. 由可加性和

$\mathbf{1}_A(x)f(x) = f(x)$ for all $x \in A$ 和 $\mathbf{1}_A(x)f(x) = 0$ for all $x \in E \setminus A$ 有

$$\begin{aligned} \int_E \mathbf{1}_A(x)f(x) dx &= \int_A \mathbf{1}_A(x)f(x) dx + \int_{E \setminus A} \mathbf{1}_A(x)f(x) dx \\ &= \int_A f(x) dx + \int_{E \setminus A} 0 dx = \int_A f(x) dx. \quad \square \end{aligned}$$

设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 我们知道 E 上的一个函数是简单函数当且仅当它是有限多个可测子集的特征函数的线性组合. 因此对任意可测子集 $A_k \subset E$ 和任意非负常数 $c_k, k = 1, 2, \dots, n$, 应用积分的线性和子集与全集的积分关系有

$$\int_E \sum_{k=1}^n c_k \mathbf{1}_{A_k}(x) dx = \sum_{k=1}^n c_k \int_E \mathbf{1}_{A_k}(x) dx = \sum_{k=1}^n c_k m(A_k). \quad (2.1.3)$$

【注】 积分记号中的 dx 有时也写作 $dm(x)$, 它称为测度元. 我们使用古典记号 dx 是因为 Lebesgue 测度保持区间体积: $m(I) = |I|$, 因此它保持 Riemann 积分的所有基本性质. 测度元 dx 中的英文字母 d 表示 difference (差或差分) 的意思, 而 dx 表示是 x 的微分小的邻域的测度 (长度、面积等). 例如对直线 \mathbb{R} 上的 Lebesgue 测度 m 和 $x > 0$, 由于包含 x 的微小区间 $[x, x + \Delta x]$ 等于大区间 $[0, x + \Delta x]$ 减去小区间 $[0, x]$ 而其长度 $\Delta x (> 0)$ 也是用差 (difference) 得到的, 即大区间的长度 $m([0, x + \Delta x]) = x + \Delta x$ 减去小区间的长度 $m([0, x]) = x$, 故数学上就用 $dx = m([0, x + \Delta x]) - m([0, x]) = \Delta x$ 表示这个微小测

度. 当然在二维和高维的情形, x 的邻域(小矩形, 小方体等等)不一定总能写成两个大矩形、长方体的差, 但是只要保持差(difference)的上述意义, 即点 x 的微小邻域的测度(长度, 面积, 体积等), 数学上就仍沿用了一维时的记号, 即用 dx 表示是在 x 的微小邻域的测度。

有了非负简单函数的积分, 借助简单函数逼近我们就可以对一般非负可测定义积分:

【定义(非负可测函数的积分)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 则对任意非负广义实值可测函数 $f: E \rightarrow [0, +\infty]$, 称非负广义实数

$$\int_E f(x)dx := \sup_{\varphi \in \mathcal{S}^+(E), \varphi \leq f \text{ on } E} \int_E \varphi(x)dx \quad (2.1.4)$$

为 f 在 E 上的关于 L -测度 m 的积分. 进一步, 若 $\int_E f(x)dx < \infty$, 则称 f 在 E 上 L -可积, 简称 f 在 E 上可积. \square

【注】 这个定义与非负简单函数积分的定义是相容的, 即当 $f \in \mathcal{S}^+(E)$ 时, 两个定义中的积分相等, 因为根据非负简单函数积分的单调性易见此时 (2.1.4) 中的上确界是最大值, 它在 $\varphi = f$ 达到.

【定理2.1.2】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 并设下面出现的集合和函数都是可测的. 则有

(a) 子集与全集的积分关系: 若 $f \geq 0$ 于 E , $A \subset E$, 则

$$\int_A f(x)dx = \int_E \mathbf{1}_A(x)f(x)dx.$$

(b) 单调性:

$$0 \leq f \leq g \text{ 于 } E \implies \int_E f(x)dx \leq \int_E g(x)dx.$$

(c) 单调性: 若 $f \geq 0$ 于 E , 则

$$A \subset B \subset E \implies \int_A f(x)dx \leq \int_B f(x)dx.$$

(d) 线性: 若 $f, g \geq 0$ 于 E , $\alpha, \beta \in [0, +\infty]$ 为广义常数, 则

$$\int_E (\alpha f(x) + \beta g(x))dx = \alpha \int_E f(x)dx + \beta \int_E g(x)dx.$$

(e) (对测度的估计) 若 $f \geq 0$ 于 E , 则

$$m(E(f \geq t)) \leq \frac{1}{t} \int_E f(x)dx \quad \forall t > 0.$$

(f) 若 $f \geq 0$ 在 E 上可积, 则 f 在 E 上几乎处处有限, 即 $m(E(f = +\infty)) = 0$, 也即

$$f \geq 0 \quad \text{and} \quad \int_E f(x)dx < \infty \implies f(x) < \infty \quad \text{a.e.} \quad x \in E.$$

(g) 如果 $f(x) \equiv 0$ 于 E , 则即使 $m(E) = +\infty$, 也有 $\int_E f(x)dx = 0$.

(h) 如果 $m(E) = 0$, 则即使 $f(x) \equiv +\infty$, 也有 $\int_E f(x)dx = 0$.

(i) 若 $f \geq 0$ 于 E 且

$$\int_E f(x)dx = 0$$

则 $m(E(f > 0)) = 0$ 即 $f(x) = 0 \quad \text{a.e.} \quad x \in E$.

(j) 设 $f > 0$ 于 E . 则

$$m(E) > 0 \implies \int_E f(x)dx > 0$$

即

$$\int_E f(x)dx = 0 \implies m(E) = 0.$$

【证】(a): 设 $A \subset E$. 对任意 $\varphi \in \mathcal{S}^+(A)$ 满足 $\varphi(x) \leq f(x), x \in A$. 令 $\Phi(x) = \varphi(x)$ 当 $x \in A$; $\Phi(x) = 0$ 当 $x \notin A$. 则 $\Phi \in \mathcal{S}^+(E)$ 且 $\mathbf{1}_A(x)\Phi(x) \leq \mathbf{1}_A(x)f(x), x \in E$. 由非负简单函数积分的子集与全集的积分关系和积分的定义有

$$\int_A \varphi(x)dx = \int_A \Phi(x)dx = \int_E \mathbf{1}_A(x)\Phi(x)dx \leq \int_E \mathbf{1}_A(x)f(x)dx.$$

对如此的 φ 的积分取上确界即得

$$\int_A f(x)dx \leq \int_E \mathbf{1}_A(x)f(x)dx.$$

另一方面对任意 $\varphi \in \mathcal{S}^+(E)$ 满足 $\varphi \leq \mathbf{1}_A f$ 于 E , 由 $\varphi \geq 0$ 得到 $\varphi = \mathbf{1}_A \varphi$ 于 E . 同时有 $\varphi(x) \leq f(x), x \in A$. 因此非负简单函数积分的子集积分与全集积分的关系有

$$\int_E \varphi(x)dx = \int_E \mathbf{1}_A(x)\varphi(x)dx = \int_A \varphi(x)dx \leq \int_A f(x)dx.$$

对如此的 φ 的积分取上确界即得反向不等式

$$\int_E \mathbf{1}_A(x)f(x)dx \leq \int_A f(x)dx.$$

(b): 设 $0 \leq f \leq g$ 于 E , 则

$$\left\{ \int_E \varphi(x)dx \mid \varphi \in \mathcal{S}^+(E) \text{ 且 } \varphi \leq f \text{ 于 } E \right\}$$

$$\subset \left\{ \int_E \varphi(x) dx \mid \varphi \in \mathcal{S}^+(E) \text{ 且 } \varphi \leq g \text{ 于 } E \right\}.$$

两边取上确界即得积分不等式.

(c): 由 (a), (b) 有

$$A \subset B \text{ 且 } f \geq 0 \text{ 于 } B \implies \int_A f(x) dx = \int_B \mathbf{1}_A(x) f(x) dx \leq \int_B f(x) dx.$$

(d): 此刻我们先跳到下面的**Levi 单调收敛定理**并完成该定理的证明, 注意在该定理的证明中我们只用到上面已证的(a),(b),(c) 和**命题2.1.1(非负简单函数的积分性质)**. 在证明了**Levi 单调收敛定理**之后我们来证明线性性质:

先设 α, β 有限, 即 $\alpha, \beta \in [0, +\infty)$. 由简单函数逼近定理, 存在 $\{f_k\}_{k=1}^\infty, \{g_k\}_{k=1}^\infty \subset \mathcal{S}^+(E)$ 使得

$$f_k(x) \nearrow f(x), \quad g_k(x) \nearrow g(x) \quad (k \rightarrow \infty) \quad \forall x \in E$$

从而有

$$\alpha f_k(x) + \beta g_k(x) \nearrow \alpha f(x) + \beta g(x) \quad (k \rightarrow \infty) \quad \forall x \in E.$$

于是应用**Levi 单调收敛定理**和非负简单函数积分的线性性质得到

$$\begin{aligned} \int_E (\alpha f + \beta g) dx &= \lim_{k \rightarrow \infty} \int_E (\alpha f_k + \beta g_k) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \left(\alpha \int_E f_k dx + \beta \int_E g_k dx \right) \\ &= \alpha \lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k dx + \beta \lim_{k \rightarrow \infty} \int_E g_k dx = \alpha \int_E f dx + \beta \int_E g dx. \end{aligned}$$

其次设 $\alpha = +\infty$ 或 $\beta = +\infty$. 此时只需证明

$$\int_E (+\infty) f(x) dx = (+\infty) \int_E f(x) dx.$$

事实上将 Levi 单调收敛定理用于函数列 $f_k(x) = kf(x)$ 就有

$$\int_E (+\infty) f dx = \int_E \lim_{k \rightarrow \infty} kf dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_E kf dx = \lim_{k \rightarrow \infty} k \int_E f dx = (+\infty) \int_E f dx.$$

(e): 设 $f \geq 0$. 因当 $x \in E(f \geq t)$ 时 $f(x) \geq t$, 应用上面已证的性质有

$$m(E(f \geq t)) = \int_{E(f \geq t)} \frac{1}{t} t dx = \frac{1}{t} \int_{E(f \geq t)} t dx \leq \frac{1}{t} \int_{E(f \geq t)} f(x) dx \leq \frac{1}{t} \int_E f(x) dx.$$

(f): 令

$$E_\infty = E(f = +\infty), \quad E_k = E(f > k).$$

则 $E_\infty \subset E_k$ ($k = 1, 2, 3, \dots$), 且由 (e) 有

$$m(E_\infty) \leq m(E_k) \leq \frac{1}{k} \int_E f(x) dx \rightarrow 0 \quad (k \rightarrow \infty).$$

所以 $m(E_\infty) = 0$.

(g): 设 $f(x) \equiv 0$ 于 E . 则由线性质和 $0 \cdot \infty = 0$ 有

$$\int_E f(x) dx = \int_E 0 dx = 0 \int_E dx = 0.$$

(h): 设 $m(E) = 0$. 则由非负简单函数积分定义有 $\int_E \varphi(x) dx = 0 \quad \forall \varphi \in \mathcal{S}^+(E)$. 因此 $\int_E f(x) dx = 0$.

(i): 设 $f \geq 0$ 于 E 且 $\int_E f dx = 0$. 则由 (e) 有

$$m(E(f \geq 1/k)) \leq k \int_E f(x) dx = 0$$

因此 $m(E(f \geq 1/k)) = 0, k = 1, 2, 3, \dots$. 注意到单调增加性

$$E(f \geq 1) \subset E(f \geq 1/2) \subset E(f \geq 1/3) \subset \dots, \quad E(f > 0) = \bigcup_{k=1}^{\infty} E(f \geq 1/k)$$

应用测度的单调收敛有

$$m(E(f > 0)) = \lim_{k \rightarrow \infty} m(E(f \geq 1/k)) = 0.$$

所以 $f = 0$ a.e. 于 E .

(j): 假设 $f > 0$ 于 E 且 $m(E) > 0$. 若此时竟然有 $\int_E f(x) dx = 0$, 则由结论(i) $\implies m(E(f > 0)) = 0$. 但 $E = E(f > 0)$, 这便导出矛盾: $m(E) = 0$.

也可用正证法: 如上 $\lim_{k \rightarrow \infty} m(E(f \geq 1/k)) = m(E(f > 0)) = m(E) > 0$, 因此存在 $k \in \mathbb{N}$ 使得 $m(E(f \geq 1/k)) > 0$, 从而由 (e) 得到

$$0 < m(E(f \geq 1/k)) \leq k \int_E f(x) dx \implies \int_E f(x) dx > 0. \quad \square$$

在经典理论中要注意带人名的定理, 因为这些定理一劳永逸地吸收了难点, 也是证明其它定理的基础.

【Levi 单调收敛定理】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 是 E 上非负可测函数列满足

$$0 \leq f_1(x) \leq f_2(x) \leq f_3(x) \leq \dots, \quad \lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = f(x) \quad \forall x \in E.$$

则

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx = \int_E f(x) dx.$$

【证】根据可测函数性质知极限函数 $f(x) = \lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x)$ 在 E 上可测. 又由 $f_k(x) \leq f_{k+1}(x) \leq f(x)$ 和积分的单调性有

$$\int_E f_k(x) dx \leq \int_E f_{k+1}(x) dx \leq \int_E f(x) dx, \quad k = 1, 2, \dots$$

因此数列 $\{\int_E f_k(x) dx\}_{k=1}^\infty$ 的极限存在并且

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx \leq \int_E f(x) dx.$$

下证反向不等式:

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx \geq \int_E f(x) dx. \quad (2.1.5)$$

若 $\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx = +\infty$, 则反向不等式自动成立. 以下假设

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx < \infty.$$

注意, 这条件避免了 ∞ 参与运算! 我们将利用积分的定义, 即从简单函数过渡. 任取 $\varphi \in \mathcal{S}^+(E)$ 满足 $\varphi \leq f$ 于 E . 将 φ 表式为

$$\varphi(x) = \sum_{i=1}^p a_i \mathbf{1}_{A_i}(x), \quad a_i \geq 0, \quad A_i \subset E.$$

任取 $0 < \lambda < 1$, 考虑集合 $E_k = E(f_k \geq \lambda\varphi)$, $k = 1, 2, \dots$. 由 $f_k(x) \leq f_{k+1}(x)$ 和 $f_k(x) \rightarrow f(x) (k \rightarrow \infty)$ 易见

$$E_1 \subset E_2 \subset E_3 \subset \dots, \quad E = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k. \quad (2.1.6)$$

事实上 $\forall x \in E$, 若 $\varphi(x) > 0$, 则 $f_k(x) \rightarrow f(x) \geq \varphi(x) > \lambda\varphi(x)$, 因此存在 k 使得 $f_k(x) \geq \lambda\varphi(x)$ 即 $x \in E_k$; 若 $\varphi(x) = 0$, 则显然对任意 k 有 $f_k(x) \geq 0 = \lambda\varphi(x)$ 即 $x \in E_k$. 所以 $E = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k$. 注意到

$$\mathbf{1}_{E_k}(x)\varphi(x) = \sum_{i=1}^p a_i \mathbf{1}_{E_k}(x) \mathbf{1}_{A_i}(x) = \sum_{i=1}^p a_i \mathbf{1}_{E_k \cap A_i}(x)$$

据非负简单函数的积分公式(2.1.3)有

$$\int_{E_k} \varphi(x) dx = \int_E \mathbf{1}_{E_k}(x) \varphi(x) dx = \sum_{i=1}^p a_i m(E_k \cap A_i), \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

对每个固定的 $i \in \{1, 2, \dots, p\}$, 由(2.1.6)有

$$A_i \cap E_1 \cap A_i \subset E_2 \cap A_i \subset E_3 \cap A_i \subset \dots, \quad A_i = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k \cap A_i.$$

据测度的单调极限定理得到

$$\lim_{k \rightarrow \infty} m(E_k \cap A_i) = m(A_i), \quad i = 1, 2, \dots, p.$$

从而有 (再次使用(2.1.3))

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_k} \varphi(x) dx = \sum_{i=1}^p a_i \lim_{k \rightarrow \infty} m(E_k \cap A_i) = \sum_{i=1}^p a_i m(A_i) = \int_E \varphi(x) dx.$$

又由 $f_k \geq 0$, $E_k = E(f_k \geq \lambda \varphi)$ 和单调性有

$$\int_E f_k(x) dx \geq \int_{E_k} f_k(x) dx \geq \int_{E_k} \lambda \varphi(x) dx = \lambda \int_{E_k} \varphi(x) dx.$$

取极限得到

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx \geq \lambda \int_E \varphi(x) dx.$$

再令 $\lambda \rightarrow 1$ 即得

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx \geq \int_E \varphi(x) dx.$$

最后由 φ 的任意性和积分的定义, 这就证明了反向不等式 (2.1.5). \square

【注】 Levi 单调收敛定理中的 “收敛” 只是习惯说法, 实际上这个定理还包括了趋于无穷的情形. 例如取 $f_k(x) \equiv k, x \in E$ 而 $m(E) > 0$, 则有 $\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} km(E) = +\infty$. 由于这个缘故, 也可称 Levi 单调收敛定理为 Levi 单调极限定理. 但数学文献上一直称之为 Levi 单调收敛定理 (Levi's monotone convergence theorem).

Levi 单调收敛定理假定了函数列的逐点单调性, 但由于不要求其它条件, 在应用上, 特别是在导出积分的其它基本性质时, 还是方便有力的。

【定理2.1.3】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f, g, f_k (k = 1, 2, \dots, n)$ 为 E 上非负可测函数. 则

(a)

$$\int_E \sum_{k=1}^n f_k(x) dx = \sum_{k=1}^n \int_E f_k(x) dx.$$

(b) 若 $E = A \cup B, A, B$ 可测且 $A \cap B = \emptyset$, 则

$$\int_E f(x) dx = \int_A f(x) dx + \int_B f(x) dx.$$

一般地, 若 $E = \bigcup_{k=1}^n E_k$, 其中 E_k 可测且互不相交, 则

$$\int_E f(x)dx = \sum_{k=1}^n \int_{E_k} f(x)dx.$$

(c) 若 $f(x) = g(x)$ a.e. $x \in E$, 则

$$\int_E f(x)dx = \int_E g(x)dx.$$

【证】(a): 对函数 f_k 的个数 n 应用归纳法并应用积分的线性性质易证 (a) 成立.

(b): 设 $E = \bigcup_{k=1}^n E_k$, 其中 E_k 可测且互不相交. 由(a)和子集与全集的积分关系有

$$\int_E f(x)dx = \int_E \left(\sum_{k=1}^n \mathbf{1}_{E_k} f(x) \right) dx = \sum_{k=1}^n \int_E \mathbf{1}_{E_k}(x) f(x) dx = \sum_{k=1}^n \int_{E_k} f(x) dx.$$

(c): 设 $f = g$ a.e. 于 E , 即 $E(f \neq g)$ 为零测集. 由性质 (b) 和零测集上的积分等于零, 有

$$\int_E f dx = \int_{E(f=g)} f dx + \int_{E(f \neq g)} f dx = \int_{E(f=g)} g dx + \int_{E(f \neq g)} g dx = \int_E g dx. \quad \square$$

【定理2.1.4(逐项积分)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 是 E 上非负可测函数列. 则成立逐项积分:

$$\int_E \sum_{k=1}^\infty f_k(x) dx = \sum_{k=1}^\infty \int_E f_k(x) dx.$$

【证】由 f_k 非负, 令 $S_n(x) = \sum_{k=1}^n f_k(x)$, $S(x) = \sum_{k=1}^\infty f_k(x)$, 则有

$$0 \leq S_n(x) \leq S_{n+1}(x), \quad n = 1, 2, 3, \dots, \quad \lim_{n \rightarrow \infty} S_n(x) = S(x) \quad \forall x \in E.$$

因 S_n 非负可测, 故其极限函数 S 非负可测. 应用 Levi 单调收敛定理, 积分的线性性质, 和广义非负项级数的定义得到

$$\int_E S(x) dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \int_E S_n(x) dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{k=1}^n \int_E f_k(x) dx = \sum_{k=1}^\infty \int_E f_k(x) dx. \quad \square$$

【定理2.1.5(可数可加性)】 设 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ ($k = 1, 2, 3, \dots$) 是一列可测集且互不相交(或稍一般些: 互不重叠, 即若 $i \neq j$ 则 $m(E_i \cap E_j) = 0$). 设 f 在 $\bigcup_{k=1}^\infty E_k$ 上非负可测, 则成立可数可加性:

$$\int_{\bigcup_{k=1}^\infty E_k} f(x) dx = \sum_{k=1}^\infty \int_{E_k} f(x) dx.$$

【证】记 $E = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k$. 先设 E_k 互不相交. 此时有 $1 = \sum_{k=1}^{\infty} \mathbf{1}_{E_k}(x), x \in E$ 从而有

$$f(x) = \sum_{k=1}^{\infty} \mathbf{1}_{E_k}(x) f(x) \quad \forall x \in E.$$

因此由非负可测函数列的逐项积分定理得到

$$\int_E f(x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_E \mathbf{1}_{E_k}(x) f(x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_{E_k} f(x) dx.$$

现在设 E_k 互不重叠. 令

$$Z = \bigcup_{(i,j) \in \mathbb{N} \times \mathbb{N}, i \neq j} E_i \cap E_j.$$

则 Z 是可数个零测集的并因而是零测集. 令 $\tilde{E} = E \setminus Z, \tilde{E}_k = E_k \setminus Z$. 则

$$\tilde{E} = \bigcup_{k=1}^{\infty} \tilde{E}_k \quad \text{且} \quad \tilde{E}_k \text{ 互不相交}.$$

因此由互不相交情形的可数可加性有

$$\int_{\tilde{E}} f(x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_{\tilde{E}_k} f(x) dx.$$

又由 $E \setminus \tilde{E} = Z, E_k \setminus \tilde{E}_k \subset Z$ 知 $E \setminus \tilde{E}, E_k \setminus \tilde{E}_k$ 都是零测集. 因此

$$\begin{aligned} \int_E f(x) dx &= \int_{\tilde{E}} f(x) dx + \int_{E \setminus \tilde{E}} f(x) dx = \int_{\tilde{E}} f(x) dx, \\ \int_{E_k} f(x) dx &= \int_{\tilde{E}_k} f(x) dx + \int_{E_k \setminus \tilde{E}_k} f(x) dx = \int_{\tilde{E}_k} f(x) dx. \end{aligned}$$

代入上式即知所证可加性成立. \square

【例(积分与级数)】设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d), f: E \rightarrow [0, +\infty]$ 可测且几乎处处有限, 即 $m(E(f = +\infty)) = 0$. 则对任意 $0 < h < \infty$ 有

$$\frac{1}{2h} \int_{E(f \geq h)} f(x) dx \leq \sum_{k=1}^{\infty} m(E(f \geq kh)) \leq \frac{1}{h} \int_{E(f \geq h)} f(x) dx.$$

【证】因

$$E(f \geq kh) = E\left(\frac{1}{h}f \geq k\right), \quad \frac{1}{h} \int_E f(x) dx = \int_E \frac{1}{h} f(x) dx$$

故以 $\frac{1}{h}f$ 代替 f 可以假定 $h = 1$. 由定理2.1.2(e) 有

$$m(E(f \geq k)) \leq \frac{1}{k} \int_{E(f \geq k)} f(x) dx \quad (k \geq 1).$$

若存在 $k_0 \geq 1$ 使得 $m(E(f \geq k_0)) = +\infty$, 则 $\int_{E(f \geq k_0)} f(x) dx = +\infty$ (从而由 $E(f \geq 1) \supset E(f \geq k_0)$ 知 $\int_{E(f \geq 1)} f(x) dx = +\infty$) 且 $\sum_{k=1}^{\infty} m(E(f \geq k)) = +\infty$. 此时所证不等式自动成立.

因此下面可以假设 $m(E(f \geq k)) < \infty, k = 1, 2, 3, \dots$. 这个有限性保证了下面推导中不涉及广义实数, 因此不会出现 “ $\infty - \infty$ ”. 此外由于零测集对测度和积分无贡献, 故若以 $E(f < \infty)$ 代替 E , 则所有积分值不变. 因此不失一般性可以假定 f 处处有限.

在 Abel 分部求和公式

$$\sum_{k=1}^N a_k b_k = \sum_{k=1}^{N-1} \left(\sum_{j=1}^k a_j \right) (b_k - b_{k+1}) + \left(\sum_{k=1}^N a_k \right) b_N, \quad N \geq 2$$

中取 $a_k = 1$ 和 $b_k = m(E(f \geq k))$ 并注意

$$b_k - b_{k+1} = m(E(f \geq k)) - m(E(f \geq k+1)) = m(E(k \leq f < k+1))$$

得到

$$\begin{aligned} \sum_{k=1}^N m(E(f \geq k)) &= \sum_{k=1}^{N-1} k m(E(k \leq f < k+1)) + N m(E(f \geq N)) \\ &\leq \sum_{k=1}^{N-1} \int_{E(k \leq f < k+1)} f(x) dx + \int_{E(f \geq N)} f(x) dx \\ &= \int_{E(1 \leq f < N)} f(x) dx + \int_{E(f \geq N)} f(x) dx = \int_{E(f \geq 1)} f(x) dx \quad (\forall N \geq 2) \end{aligned}$$

这里用到了积分的可加性. 令 $N \rightarrow \infty$ 即得

$$\sum_{k=1}^{\infty} m(E(f \geq k)) \leq \int_{E(f \geq 1)} f(x) dx.$$

另一方面我们有

$$\begin{aligned} \sum_{k=1}^N m(E(f \geq k)) &\geq \sum_{k=1}^{N-1} k m(E(k \leq f < k+1)) \\ &\geq \frac{1}{2} \sum_{k=1}^{N-1} (k+1) m(E(k \leq f < k+1)) \geq \frac{1}{2} \sum_{k=1}^{N-1} \int_{E(k \leq f < k+1)} f(x) dx. \end{aligned}$$

令 $N \rightarrow \infty$ 得到

$$\sum_{k=1}^{\infty} m(E(f \geq k)) \geq \frac{1}{2} \sum_{k=1}^{\infty} \int_{E(k \leq f < k+1)} f(x) dx.$$

注意 f 处处有限: $0 \leq f(x) < \infty$ for all $x \in E$, 我们有分解

$$E(f \geq 1) = E(1 \leq f < \infty) = \bigcup_{k=1}^{\infty} E(k \leq f < k+1).$$

据积分的可加性便有

$$\int_{E(f \geq 1)} f(x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_{E(k \leq f < k+1)} f(x) dx.$$

因此

$$\sum_{k=1}^{\infty} m(E(f \geq k)) \geq \frac{1}{2} \int_{E(f \geq 1)} f(x) dx. \quad \square$$

【定理2.1.6(积分的扩张)】 设 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 单调增加:

$$E_1 \subset E_2 \subset E_3 \subset \cdots, \quad E := \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k.$$

则对 E 上的任一非负可测函数 f 有

$$\int_E f(x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_k} f(x) dx.$$

【证】 由假设条件有

$$0 \leq f(x) \mathbf{1}_{E_k}(x) \leq f(x) \mathbf{1}_{E_{k+1}}(x), \quad k = 1, 2, \dots; \quad \lim_{k \rightarrow \infty} f(x) \mathbf{1}_{E_k}(x) = f(x)$$

for all $x \in E$. **【事实上对任意 $x \in E$, 存在 $N \in \mathbb{N}$ 使得 $x \in E_N$. 因此当 $k \geq N$ 时 $\mathbf{1}_{E_k}(x) = 1$, 从而有 $\lim_{k \rightarrow \infty} f(x) \mathbf{1}_{E_k}(x) = f(x)$.】** 应用 Levi 单调收敛定理即得

$$\int_E f(x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f(x) \mathbf{1}_{E_k}(x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_k} f(x) dx. \quad \square$$

【定理2.1.7(积分的收缩)】 设 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 单调减少:

$$E_1 \supset E_2 \supset E_3 \supset \cdots; \quad E := \bigcap_{k=1}^{\infty} E_k.$$

若 f 是 E_1 上的非负可测函数且

$$\int_{E_1} f(x) dx < \infty,$$

则有

$$\int_E f(x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_k} f(x) dx.$$

【证】由假设知

$$E_1 \setminus E_k \subset E_1 \setminus E_{k+1}, \quad k = 1, 2, 3, \dots; \quad \bigcup_{k=1}^{\infty} (E_1 \setminus E_k) = E_1 \setminus \bigcap_{k=1}^{\infty} E_k = E_1 \setminus E.$$

故应用上述积分扩张定理并注意 $\int_{E_k} f(x)dx \leq \int_{E_1} f(x)dx < \infty$ 即得

$$\begin{aligned} \int_{E_1} f(x)dx - \int_E f(x)dx &= \int_{E_1 \setminus E} f(x)dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_1 \setminus E_k} f(x)dx \\ &= \lim_{k \rightarrow \infty} \left(\int_{E_1} f(x)dx - \int_{E_k} f(x)dx \right) = \int_{E_1} f(x)dx - \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_k} f(x)dx. \end{aligned}$$

消去 $\int_{E_1} f(x)dx < \infty$ 即得所证. \square

【例】用积分的方法证明Borel-Cantelli 引理:

设 $E = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k$, $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $k = 1, 2, 3, \dots$ 满足 $\sum_{k=1}^{\infty} m(E_k) < \infty$. 则 E 中几乎所有点至多同时属于有限多个 E_k .

【证】根据“几乎处处”的定义, 本题是说 E 中同时属于无限多个 E_k 的点的集合是一个零测集, 即集合

$$Z := \{x \in E \mid \text{存在严格增加的自然数列 } \{k_j\}_{j=1}^{\infty} \text{ 使得 } x \in \bigcap_{j=1}^{\infty} E_{k_j}\}$$

是零测集. 前面讲过, 特征函数是个好东西, 它把集合与数值联系起来了. 所以我们可以进一步分析: 考虑可测函数

$$f(x) := \sum_{k=1}^{\infty} \mathbf{1}_{E_k}(x), \quad x \in E.$$

则易见 $x \in Z$ 当且仅当有无限多个 $\mathbf{1}_{E_k}(x)$ 等于 1, 即当且仅当 $f(x) = +\infty$. 因此

$$Z = E(f = +\infty).$$

于是为证明 $m(Z) = 0$, 充分地我们只要证明 f 在 E 上可积, 即 $\int_E f(x)dx < \infty$. 由非负可测函数的逐项积分和题目假设有

$$\int_E f(x)dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_E \mathbf{1}_{E_k}(x)dx = \sum_{k=1}^{\infty} m(E_k) < \infty.$$

所以 f 的确在 E 上可积. 因此 $m(Z) = 0$. \square

下面这个Fatou引理属于那种证明简单但经常使用的一类.

【Fatou引理】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 是 E 上的任一非负可测函数列. 则有

$$\int_E \liminf_{k \rightarrow \infty} f_k(x) dx \leq \liminf_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx.$$

特别若 $f_k(x) \rightarrow f(x)$ a.e. $x \in E$, 则

$$\int_E f(x) dx \leq \liminf_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx.$$

【证】 令 $F_k(x) = \inf_{j \geq k} f_j(x)$. 则

$$0 \leq F_k(x) \leq F_{k+1}(x), \quad k = 1, 2, \dots; \quad \lim_{k \rightarrow \infty} F_k(x) = \liminf_{k \rightarrow \infty} f_k(x) \quad \forall x \in E.$$

由 Levi 单调收敛定理和 $F_k \leq f_k$ 得到

$$\begin{aligned} \int_E \liminf_{k \rightarrow \infty} f_k(x) dx &= \lim_{k \rightarrow \infty} \int_E F_k(x) dx \\ &= \liminf_{k \rightarrow \infty} \int_E F_k(x) dx \leq \liminf_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx. \end{aligned}$$

这证明了引理的第一部分.

现在设 $f_k(x) \rightarrow f(x)$ a.e. $x \in E$, 则由几乎处处的定义, 知

$$Z = \{x \in E \mid f_k(x) \not\rightarrow f(x) (k \rightarrow \infty)\}$$

是零测集, 同时由可测函数性质知 f 是 E 上的可测函数. 因零测集对积分无贡献, 故将引理的第一部分应用于 $E \setminus Z$ 得到

$$\begin{aligned} \int_E f(x) dx &= \int_{E \setminus Z} f(x) dx = \int_{E \setminus Z} \liminf_{k \rightarrow \infty} f_k(x) dx \\ &\leq \liminf_{k \rightarrow \infty} \int_{E \setminus Z} f_k(x) dx = \liminf_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx. \end{aligned} \quad \square$$

作业题 (2018-3-30留)

Stein和Shakarchi的《实分析》第2章第5节习题10.

周民强《实变函数论》(第2版2008年, 北大出版社) P161 思考题1,4,5,6; P168 思考题9,10,12; P220 习题4 第一组习题1,2,3,5; 第二组习题1,2,5,6.

§2.2. 一般可测函数的积分

设 $f: E \rightarrow [-\infty, +\infty]$. 回忆: f 可表示为它的正部和负部之差:

$$f(x) = f^+(x) - f^-(x), \quad x \in E$$

$$f^+(x) := \max\{f(x), 0\} = \frac{|f(x)| + f(x)}{2} = f(x)\mathbf{1}_{E(f \geq 0)}(x) \geq 0,$$

$$f^-(x) := (-f)^+(x) = \frac{|f(x)| - f(x)}{2} = -f(x)\mathbf{1}_{E(f \leq 0)}(x) \geq 0.$$

【注】 若 f 在 E 上可测, 则 f^\pm 都在 E 上非负可测. 此外易见对每个 $x \in E$, $f^+(x)$ 与 $f^-(x)$ 必有一个为零, 因此在上述分解中不会出现 “ $\infty - \infty$ ”.

【定义】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f: E \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 可测.

(i) 如果 f^+ 和 f^- 中至少有一个在 E 上 L -可积, 即 $\int_E f^+(x)dx, \int_E f^-(x)dx$ 中至少有一个为有限, 则称广义实数

$$\int_E f(x)dx := \int_E f^+(x)dx - \int_E f^-(x)dx$$

为 f 在 E 上关于 Lebesgue 测度的积分, 同时称积分 $\int_E f(x)dx$ 存在.

(ii) 若 f^+ 和 f^- 都在 E 上 L -可积, 则称 f 在 E 上 L -可积, 有时简称可积. 在 E 上 L -可积的函数的全体记为 $L^1(E)$.

(iii) 对一维情形, 当 E 是区间 (有界、无界、开、闭、半开半闭), 也即当 $E = [a, b], (a, b), [a, b), (a, b]$ 时, 由于端点 a, b 对积分没有贡献, 区间上的积分一律记为

$$\int_E f(x)dx = \int_a^b f(x)dx. \quad \square$$

【注】 由 $|f| = f^+ + f^-$ 和

$$\int_E |f(x)|dx = \int_E f^+(x)dx + \int_E f^-(x)dx$$

易见 (当 f 在 E 上可测时)

$$f \in L^1(E) \iff |f| \in L^1(E) \iff \int_E |f(x)|dx < \infty.$$

因此对于 Lebesgue 积分而言, 可积等价于绝对可积. 当 $f \in L^1(E)$ 时记

$$\|f\|_{L^1} = \|f\|_{L^1(E)} = \int_E |f(x)|dx.$$

下面给出积分的基本性质. 由于证明简单, 我们将定理的陈述与证明并行.

【定理2.2.1(积分的基本性质)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, f, g 为 E 上广义实值可测函数.

(a) 若 $\int_E f(x)dx$ 存在, 则

$$\left| \int_E f(x)dx \right| \leq \int_E |f(x)|dx.$$

这是因为

$$\left| \int_E f(x)dx \right| = \left| \int_E f^+(x)dx - \int_E f^-(x)dx \right| \leq \int_E f^+(x)dx + \int_E f^-(x)dx = \int_E |f(x)|dx.$$

(b) 若 $\int_E g(x)dx$ 存在并且 $f(x) = g(x)$ a.e. $x \in E$, 则 $\int_E f(x)dx$ 存在且

$$\int_E f(x)dx = \int_E g(x)dx.$$

这是因为 $m(E(f \neq g)) = 0 \implies$

$$\int_E f^\pm(x)dx = \int_{E(f=g)} f^\pm(x)dx = \int_{E(f=g)} g^\pm(x)dx = \int_E g^\pm(x)dx.$$

(c) 若 $\int_E f(x)dx, \int_E g(x)dx$ 都存在并且 $f(x) \leq g(x)$ a.e. $x \in E$, 则

$$\int_E f(x)dx \leq \int_E g(x)dx.$$

这是因为

$$f(x) \leq g(x) \implies f^+(x) \leq g^+(x), \quad f^-(x) \geq g^-(x)$$

因此结合 $m(E(f > g)) = 0$ 有

$$\int_E f^+dx = \int_{E(f \leq g)} f^+dx \leq \int_{E(f \leq g)} g^+dx = \int_E g^+dx,$$

$$\int_E f^-dx = \int_{E(f \leq g)} f^-dx \geq \int_{E(f \leq g)} g^-dx = \int_E g^-dx$$

\implies

$$\int_E fdx = \int_E f^+dx - \int_E f^-dx \leq \int_E g^+dx - \int_E g^-dx = \int_E gdx.$$

(d) 若 $f \in L^1(E)$ 而 $A \subset E$ 是可测集, 则 $f \in L^1(A)$ 且

$$\int_A |f(x)|dx \leq \int_E |f(x)|dx.$$

这是由于此时 f 也在 A 上可测. 因此不等式属于非负可测函数积分的单调性的结论.

(e) 若 f 在 E 上有界, 且 $m(E) < \infty$, 则 $f \in L^1(E)$.

这是因为 $\sup_{x \in E} |f(x)| \leq M < \infty$ 和 $m(E) < \infty \implies$

$$\int_E |f(x)| dx \leq \int_E M dx = M \cdot m(E) < \infty.$$

(f) 若 $0 \leq g \in L^1(E)$ 而 $|f(x)| \leq g(x)$ a.e. $x \in E$, 则 $f \in L^1(E)$.

这是因为 (由(c))

$$\int_E |f(x)| dx \leq \int_E g(x) dx < \infty.$$

(g) 若 $f \in L^1(E)$, 则 f 在 E 上几乎处处有限, 即 $m(E(|f| = \infty)) = 0$.

事实上将非负可测函数积分的**定理2.1.2(f)**应用于 $|f|$, 并注意 $\int_E |f(x)| dx < \infty$, 即得结论.

(h)(线性性和三角不等式). 可积函数类 $L^1(E)$ 是一个线性空间, 即若 $f, g \in L^1(E)$, $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$ 为常数, 则 $\alpha f + \beta g \in L^1(E)$, 并成立线性性:

$$\int_E (\alpha f(x) + \beta g(x)) dx = \alpha \int_E f(x) dx + \beta \int_E g(x) dx$$

和三角不等式:

$$\int_E |f(x) + g(x)| dx \leq \int_E |f(x)| dx + \int_E |g(x)| dx.$$

【(h)的证明】 设 $f, g \in L^1(E)$, $\alpha \in \mathbb{R}^1$ 为常数. 由结论 (f) 知 f, g 在 E 上几乎处处有限. 因此由可测函数的基本性质知 $\alpha f, f + g$ 都是 E 上的可测函数. 又由

$$|\alpha f(x)| = |\alpha| |f(x)|, \quad |f(x) + g(x)| \leq |f(x)| + |g(x)|$$

和非负可测函数的积分性质有

$$\begin{aligned} \int_E |\alpha f(x)| dx &= |\alpha| \int_E |f(x)| dx < \infty, \\ \int_E |f(x) + g(x)| dx &\leq \int_E (|f(x)| + |g(x)|) dx = \int_E |f(x)| dx + \int_E |g(x)| dx < \infty. \end{aligned}$$

因此 $\alpha f, f + g \in L^1(E)$. 这同时证明了三角不等式.

为证明线性性, 只需证明

$$\int_E \alpha f(x) dx = \alpha \int_E f(x) dx, \quad \int_E (f(x) + g(x)) dx = \int_E f(x) dx + \int_E g(x) dx.$$

根据函数的正、负部的定义易见：当 $\alpha \geq 0$ 时，

$$(\alpha f)^+(x) + \alpha f^-(x) = \alpha f^+(x) + (\alpha f)^-(x),$$

从而有

$$\int_E (\alpha f)^+ dx + \alpha \int_E f^- dx = \alpha \int_E f^+ dx + \int_E (\alpha f)^- dx < \infty.$$

移项即得

$$\int_E \alpha f(x) dx = \alpha \int_E f(x) dx.$$

而当 $\alpha < 0$ 时，

$$(\alpha f)^+(x) = \max\{\alpha f(x), 0\} = \max\{-(-\alpha)f(x), 0\} = (-\alpha f)^-(x),$$

$$(-\alpha)f^+(x) = -\alpha \max\{f(x), 0\} = \max\{-\alpha f(x), 0\} = (\alpha f)^-(x)$$

$$\implies (\alpha f)^+(x) + (-\alpha)f^+(x) = (\alpha f)^-(x) + (-\alpha)f^-(x),$$

从而有

$$\int_E (\alpha f)^+ dx + (-\alpha) \int_E f^+ dx = \int_E (\alpha f)^- dx + (-\alpha) \int_E f^- dx < \infty.$$

移项后同样得到

$$\int_E \alpha f(x) dx = \alpha \int_E f(x) dx.$$

最后设 $Z = E(|f| = +\infty) \cup E(|g| = +\infty)$. 则 $m(Z) = 0$. 于是在 $E \setminus Z$ 上，

以下运算有意义：

$$(f+g)^+ - (f+g)^- = f+g = f^+ + g^+ - f^- - g^-,$$

$$\implies (f+g)^+ + f^- + g^- = (f+g)^- + f^+ + g^+.$$

因零测集对积分没有贡献，对这些非负函数在整个 E 上取积分得到

$$\int_E (f+g)^+ dx + \int_E f^- dx + \int_E g^- dx = \int_E (f+g)^- dx + \int_E f^+ dx + \int_E g^+ dx < \infty.$$

移项即得所证等式. \square

【注】当 f 在 E 上可积时，由于 $E(|f| = +\infty)$ 是零测集，而去掉零测集不改变可积性和积分值，故永远可以用 $E(|f| < \infty)$ 代替 E ，即可以假定 f 在 E 上处处有限。同样，当 f 和可数多个函数 f_k 在 E 上可积时，

$$Z := E(|f| = +\infty) \cup \bigcup_{k=1}^{\infty} E(|f_k| = +\infty) \quad \text{是零测集}$$

故可以用 $E \setminus Z$ 代替 E . 这就使得减法运算 $f_k(x) - f(x), f_k(x) - f_j(x)$ 等等运算有意义。

现在我们可以证明 现代积分理论中最有力最常用的几个定理: Lebesgue 控制收敛定理, 逐项积分定理, 可数可加定理, 积分的绝对连续性, 等.

【Lebesgue 控制收敛(LDC)定理】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, E 上的可测函数 $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 满足

$$(i) \quad \lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = f(x) \quad \text{a.e.} \quad x \in E,$$

(ii) 存在函数 $0 \leq F \in L^1(E)$ 使得

$$|f_k(x)| \leq F(x), \quad \forall x \in E, \quad \forall k = 1, 2, 3, \dots$$

则 $f_k, f \in L^1(E)$ 且

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |f_k(x) - f(x)| dx = 0$$

从而有

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx = \int_E f(x) dx.$$

【Lebesgue 控制收敛(LDC)定理的推广形式】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, E 上的可测函数列 $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 和非负函数列 $\{F_k\}_{k=1}^\infty, F$ 满足

$$(i) \quad \lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = f(x), \quad \lim_{k \rightarrow \infty} F_k(x) = F(x) \quad \text{a.e.} \quad x \in E,$$

$$(ii) \quad |f_k(x)| \leq F_k(x), \quad \forall x \in E, \quad \forall k = 1, 2, 3, \dots$$

$$(iii) \quad F_k, F \in L^1(E) \quad \text{且} \quad \lim_{k \rightarrow \infty} \int_E F_k(x) dx = \int_E F(x) dx.$$

则 $f_k, f \in L^1(E)$ 且

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |f_k(x) - f(x)| dx = 0$$

从而有

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx = \int_E f(x) dx.$$

【注】 LDC 是 Lebesgue Dominated Convergence (Lebesgue 控制收敛) 的缩写. 在推广形式的LDC中的一个特殊情形是 $F_k \equiv F$, 此时即为原版LDC. 两个定理中条件 (ii) 中的函数 F (相应地 F_k) 称为 f_k 的控制函数. 控制函数可以有很多, 例如若 F (相应地 F_k) 是 f_k 的控制函数, 而若 $0 \leq G \in L^1(E)$, 则 $3F$ 和 $F + G$ (相应地 $3F_k, F_k + G$) 也都是 f_k 的控制函数. 但 $|f_k|$ 一般不是 f_k 的控制函数除非 $F_k := |f_k|, F := |f|$ 满足推广形式的LDC中的条件(iii).

【定理的证明】只需证推广形式的LDC. 由 $F_k, F \in L^1(E)$ 和 $|f_k| \leq F_k$ 知 $f_k \in L^1(E)$.

再由假设(i)知 $\lim_{k \rightarrow \infty} |f_k(x)| = |f(x)|$ a.e. $x \in E$, 于是由Fatou 引理有

$$\int_E |f(x)| dx \leq \liminf_{k \rightarrow \infty} \int_E |f_k(x)| dx \leq \liminf_{k \rightarrow \infty} \int_E F_k(x) dx = \int_E F(x) dx < \infty.$$

于是所有函数 f_k, F_k, f, F 都是可积的因而几乎处处有限. 令

$$Z = E(f_k \not\rightarrow f) \cup E(F_k \not\rightarrow F) \cup E(|f| + F = +\infty) \cup \bigcup_{k=1}^{\infty} E(|f_k| + F_k = +\infty).$$

则 $m(Z) = 0$. 由于去掉一个零测集不改变积分值, 我们可以以 $E \setminus Z$ 代替 E , 也即可以假定 $f_k(x), f(x), F_k(x), F(x)$ 在 E 上处处有限. 于是减法 $f_k(x) - f(x)$ 处处有意义, 等等. 令

$$g_k(x) = |f_k(x) - f(x)|.$$

则

$$g_k \in L^1(E), \quad g_k(x) \rightarrow 0 \quad (k \rightarrow \infty) \quad \forall x \in E,$$

$$0 \leq g_k(x) \leq F_k(x) + F(x) \quad \forall x \in E, \quad \forall k = 1, 2, 3, \dots$$

对非负可测函数 $F_k + F - g_k$ 应用 Fatou 引理和数列的上下极限关系有

$$\begin{aligned} 2 \int_E F dx &= \int_E \lim_{k \rightarrow \infty} (F_k + F) dx = \int_E \lim_{k \rightarrow \infty} (F_k + F - g_k) dx \\ &\leq \liminf_{k \rightarrow \infty} \int_E (F_k + F - g_k) dx = \liminf_{k \rightarrow \infty} \left(\int_E F_k dx + \int_E F dx - \int_E g_k dx \right) \\ &\leq \limsup_{k \rightarrow \infty} \left(\int_E F_k dx + \int_E F dx \right) + \liminf_{k \rightarrow \infty} \left(- \int_E g_k dx \right) \\ &= 2 \int_E F dx - \limsup_{k \rightarrow \infty} \int_E g_k dx. \end{aligned}$$

消去有限数 $2 \int_E F dx < +\infty$ (这儿用到 F 的可积性!), 即得

$$\limsup_{k \rightarrow \infty} \int_E g_k(x) dx \leq 0.$$

但 $g_k \geq 0$ 于 E , 所以 $\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E g_k(x) dx = 0$ 即

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |f_k(x) - f(x)| dx = 0.$$

最后由积分不等式得到

$$\left| \int_E f_k dx - \int_E f dx \right| = \left| \int_E (f_k - f) dx \right| \leq \int_E |f_k - f| dx \rightarrow 0 \quad (k \rightarrow \infty). \quad \square$$

【重要例题】设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f \in L^1(E)$. 则按积分范数, f 可以被有界的可积函数逼近. 具体来说, 令 $f_M(x) = f(x)\mathbf{1}_{E(|f| \leq M)}(x)$, $0 < M < \infty$. 则 f_M 是有界的可积函数且

$$\int_E |f(x) - f_M(x)| dx = \int_{E(|f| > M)} |f(x)| dx \rightarrow 0 \quad (M \rightarrow +\infty).$$

【证】易见 f_M 是可测函数且 $|f_M(x)| = |f(x)|\mathbf{1}_{E(|f| \leq M)}(x) \leq \min\{|f(x)|, M\}$, $x \in E$. 因此 f_M 是有界的可积函数. 同时有 $|f(x) - f_M(x)| = |f(x)|\mathbf{1}_{E(|f| > M)}(x)$,

$$\int_E |f(x) - f_M(x)| dx = \int_E |f(x)|\mathbf{1}_{E(|f| > M)}(x) dx = \int_{E(|f| > M)} |f(x)| dx.$$

由 f 可积知 f 在 E 上几乎处处有限, 即 $Z = E(|f| = +\infty)$ 是零测集. 令 $E_1 = E \setminus Z$. 则 $E = E_1 \cup Z$. 因零测集对积分无贡献, 故我们可以以 E_1 代替 E , 即可以假定 f 在 E 上处处有限即 $E = E(|f| < \infty)$. 其次我们注意: 只需证明当 M 取正整数值 (即 $M = k \in \mathbb{N}$) 时有

$$\int_{E(|f| > k)} |f(x)| dx \rightarrow 0 \quad (k \rightarrow \infty). \quad (2.2.1)$$

事实上若 (2.2.1) 成立, 令 $[M]$ 为不超过 M 的最大整数, 则由 $M \geq [M]$ 有 $E(|f| > M) \subset E(|f| > [M])$ 从而由非负函数积分的单调性即得

$$\int_{E(|f| > M)} |f(x)| dx \leq \int_{E(|f| > [M])} |f(x)| dx \rightarrow 0 \quad (M \rightarrow +\infty).$$

[证法1:] 为了保持积分集合是固定的, 即不依赖于 k , 从而可使用LDC, 我们使用特征函数: 令

$$g_k(x) := |f(x)|\mathbf{1}_{E(|f| > k)}(x), \quad x \in E, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

则有

$$\int_{E(|f| > k)} |f(x)| dx = \int_E g_k(x) dx.$$

对任意 $x \in E = E(|f| < \infty)$ 有 $|f(x)| < \infty$, 因此当 $k > |f(x)|$ 时, $\mathbf{1}_{E(|f| > k)}(x) = 0$, 从而有 $g_k(x) = 0$. 由此可知

$$\lim_{k \rightarrow \infty} g_k(x) = 0 \quad \forall x \in E; \quad |g_k(x)| \leq |f(x)| \quad \forall x \in E, \quad \forall k \in \mathbb{N}.$$

因 $|f| \in L^1(E)$, 故由LDC 有

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E g_k(x) dx = 0.$$

所以 (2.2.1) 成立.

[证法2:]为证(2.2.1), 令

$$f_k(x) = |f(x)|\mathbf{1}_{E(f \leq k)}(x), \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

则对任意 $x \in E$ 有

$$0 \leq f_k(x) \leq f_{k+1}(x) \leq |f(x)| \quad (k = 1, 2, 3, \dots); \quad f_k(x) \rightarrow |f(x)| \quad (k \rightarrow \infty).$$

对 $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 应用 LDC (可取 $|f|$ 为控制函数因为 $|f|$ 可积) 或 Levi 单调收敛定理并注意 $|f(x)| - f_k(x) = |f(x)|\mathbf{1}_{E(f > k)}(x)$, 得到

$$\int_{E(f > k)} |f| dx = \int_E (|f| - f_k) dx = \int_E |f| dx - \int_E f_k dx \rightarrow 0 \quad (k \rightarrow \infty). \quad \square$$

LDC 的一个特殊且常用的情形是下列有界收敛定理:

【Lebesgue有界收敛定理】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 为 E 上的一列可测函数, 满足

- (i) $m(E) < \infty$,
- (ii) $\lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = f(x) \quad \text{a.e. } x \in E$,
- (iii) $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 在 E 上一致有界, 即存在常数 $0 \leq M < \infty$ 使得

$$|f_k(x)| \leq M \quad \forall x \in E, \quad \forall k = 1, 2, 3, \dots$$

则 $f \in L^1(E)$ 且

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |f_k(x) - f(x)| dx = 0$$

从而有

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E f_k(x) dx = \int_E f(x) dx.$$

【证】 由 $m(E) < \infty$ 知常值函数 $F(x) = M$ 在 E 上可积: $\int_E F(x) dx = Mm(E) < \infty$.

因此由假设知 F 是 $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 的控制函数. 这就转化为 LDC, 遂得证. \square

很多情况下我们会遇到带连续参数的函数族. 相应地我们有

【连续参变量的Lebesgue控制收敛定理】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $I \subset \mathbb{R}^l$, 0 是 I 的一个聚点, $\{f_h\}_{h \in I}$ 是 E 上的一族可测函数, 满足

- (i) $\lim_{I \ni h \rightarrow 0} f_h(x) = f(x) \quad \text{a.e. } x \in E$.

(ii) 存在函数 $0 \leq F \in L^1(E)$ 使得 $|f_h(x)| \leq F(x) \quad \forall x \in E, \forall h \in I$.

则 $f \in L^1(E)$ 且

$$\lim_{I \ni h \rightarrow 0} \int_E |f_h(x) - f(x)| dx = 0$$

从而有

$$\lim_{I \ni h \rightarrow 0} \int_E f_h(x) dx = \int_E f(x) dx.$$

【证】任取点列 $\{h_k\}_{k=1}^\infty \subset I$ 满足 $h_k \neq 0, h_k \rightarrow 0 (k \rightarrow \infty)$, 由假设 (i), (ii) 可见 $\{f_{h_k}\}_{k=1}^\infty, f, F$ 满足函数列情形的 LDC 的条件. 因此 $f \in L^1(E)$ 且

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |f_{h_k}(x) - f(x)| dx = 0.$$

再由 $\{h_k\}_{k=1}^\infty$ 的任意性即得所证. \square

【连续参变量的有界收敛定理】设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $I \subset \mathbb{R}^l$, 0 是 I 的一个聚点, $\{f_h\}_{h \in I}$ 是 E 上的一族可测函数, 满足

(i) $\lim_{I \ni h \rightarrow 0} f_h(x) = f(x) \quad \text{a.e. } x \in E$.

(ii) $\{f_h\}_{h \in I}$ 一致有界, 即 $\sup_{x \in E, h \in I} |f_h(x)| < \infty$.

(iii) $m(E) < \infty$.

则 $f \in L^1(E)$ 且

$$\lim_{I \ni h \rightarrow 0} \int_E |f_h(x) - f(x)| dx = 0$$

从而有

$$\lim_{I \ni h \rightarrow 0} \int_E f_h(x) dx = \int_E f(x) dx.$$

【证】令 $M = \sup_{x \in E, h \in I} |f_h(x)|$, 则 $0 \leq M < \infty$. 由 $m(E) < \infty$ 知常值函数 $F(x) = M$ 在 E 上可积: $\int_E F(x) dx = Mm(E) < \infty$. 因此 F 是 $\{f_h\}_{h \in I}$ 的可积的控制函数. 据上一定理即得证. \square

【定理2.2.2(逐项积分)】设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 若 $f_k \in L^1(E)$, $k = 1, 2, 3, \dots$ 满足

$$\sum_{k=1}^{\infty} \int_E |f_k(x)| dx < \infty$$

则函数级数 $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$ 在 E 上几乎处处绝对收敛, 且和函数 $\sum_{k=1}^{\infty} f_k$ 在 E 上可积并成立逐项积分:

$$\int_E \sum_{k=1}^{\infty} f_k(x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_E f_k(x) dx$$

和

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |S_k(x) - S(x)| dx = 0$$

其中 $S_k(x) = \sum_{k=1}^n f_k(x)$, $S(x) = \sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$.

【证】令 $F(x) = \sum_{k=1}^{\infty} |f_k(x)|$. 则 F 是 E 上非负可测函数. 由非负可测函数的逐项积分定理和假设条件有

$$\int_E F(x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_E |f_k(x)| dx < \infty.$$

因此 $F \in L^1(E)$. 这蕴涵 F 在 E 上几乎处处有限, 即

$$\sum_{k=1}^{\infty} |f_k(x)| < \infty \quad \text{a.e. } x \in E$$

也即函数级数 $S(x) = \sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$ 在 E 上几乎处处绝对收敛. 因此 (由级数收敛的定义)

$$S_k(x) \rightarrow S(x) \quad (k \rightarrow \infty) \quad \text{a.e. } x \in E;$$

$$|S_k(x)| \leq \sum_{k=1}^n |f_k(x)| \leq F(x), \quad x \in E, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

应用 LDC (注意 LDC 已蕴涵 $S \in L^1(E)$) 有 $\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |S_k(x) - S(x)| dx = 0$ 从而由积分的线性性和级数收敛的定义得到

$$\int_E S(x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_E S_k(x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \sum_{k=1}^n \int_E f_k(x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_E f_k(x) dx.$$

□

在应用这一定理时, 一般是先对非负函数级数 $\sum_{k=1}^{\infty} |f_k(x)|$ 逐项积分, 这一步总是可行的, 除了要求 f_k 可测外, 没有任何限制. 如果 $\sum_{k=1}^{\infty} \int_E |f_k| dx < \infty$, 则可以对 $\sum_{k=1}^{\infty} f_k(x)$ 逐项积分.

【定理2.2.3(可数可加性)】设 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ ($k = 1, 2, 3, \dots$) 且 E_k 互不相交(或稍一般些: 互不重叠, 即若 $i \neq j$ 则 $m(E_i \cap E_j) = 0$). 令 $E = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k$ 并设 $f \in L^1(E)$. 则成立可加性:

$$\int_E f(x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_{E_k} f(x) dx.$$

【证】令 $f_k(x) = f(x) \mathbf{1}_{E_k}(x)$. 由非负可测函数的积分可加性有

$$\sum_{k=1}^{\infty} \int_E |f_k(x)| dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_{E_k} |f(x)| dx = \int_E |f(x)| dx < \infty.$$

于是应用逐项积分定理得

$$\int_E \sum_{k=1}^{\infty} f_k(x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_E f_k(x) dx.$$

另一方面, 由 E_k 互不相交和 $E = \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k$ 有

$$\begin{aligned} \sum_{k=1}^{\infty} \mathbf{1}_{E_k}(x) &= \mathbf{1}_{\bigcup_{k=1}^{\infty} E_k}(x) = \mathbf{1}_E(x) = 1, \quad x \in E \\ \Rightarrow \sum_{k=1}^{\infty} f_k(x) &= f(x) \sum_{k=1}^{\infty} \mathbf{1}_{E_k}(x) = f(x), \quad x \in E. \end{aligned}$$

所以

$$\int_E f(x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_{E_k} f(x) dx.$$

现在设 E_k 互不重叠. 令

$$Z = \bigcup_{(i,j) \in \mathbb{N} \times \mathbb{N}, i \neq j} E_i \cap E_j.$$

则 Z 是可数个零测集的并因而是零测集. 令 $\tilde{E} = E \setminus Z$, $\tilde{E}_k = E_k \setminus Z$. 则

$$\tilde{E} = \bigcup_{k=1}^{\infty} \tilde{E}_k \quad \text{且} \quad \tilde{E}_k \text{ 互不相交.}$$

因此由互不相交情形的可数可加性有

$$\int_{\tilde{E}} f(x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_{\tilde{E}_k} f(x) dx.$$

又由 $E \setminus \tilde{E} = Z$, $E_k \setminus \tilde{E}_k \subset Z$ 知 $E \setminus \tilde{E}$, $E_k \setminus \tilde{E}_k$ 都是零测集. 因此

$$\begin{aligned} \int_E f(x) dx &= \int_{\tilde{E}} f(x) dx + \int_{E \setminus \tilde{E}} f(x) dx = \int_{\tilde{E}} f(x) dx, \\ \int_{E_k} f(x) dx &= \int_{\tilde{E}_k} f(x) dx + \int_{E_k \setminus \tilde{E}_k} f(x) dx = \int_{\tilde{E}_k} f(x) dx. \end{aligned}$$

代入上式即知所证可加性成立. \square

【并集上的积分的分拆】 很多时候我们需要建立一个函数分别在每个特定类型的集合上的积分与这函数在这些特定集合的并集上的积分的关系式. 下面这个定理给出了一种这样的关系式.

【定理2.2.4(并集上积分的分拆)】 设 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $k = 1, 2, 3, \dots, n$, 并设 $f \in L^1(\bigcup_{k=1}^n E_k)$. 则有

$$\begin{aligned} \int_{\bigcup_{k=1}^n E_k} f(x) dx &= \sum_{k=1}^n \int_{E_k} f(x) dx - \sum_{1 \leq i < j \leq n} \int_{E_i \cap E_j} f(x) dx \\ &+ \sum_{1 \leq i < j < k \leq n} \int_{E_i \cap E_j \cap E_k} f(x) dx + \cdots + (-1)^{n-1} \int_{E_1 \cap E_2 \cap \cdots \cap E_n} f(x) dx \end{aligned}$$

即

$$\int_{\bigcup_{k=1}^n E_k} f(x) dx = \sum_{j=1}^n (-1)^{j-1} \sum_{1 \leq k_1 < k_2 < \cdots < k_j \leq n} \int_{E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_j}} f(x) dx.$$

【证】我们将使用下面的多项展开式(对 n 用归纳法即可证明): 设 a_k 为实数或复数, $k = 1, 2, \dots, n$. 则有

$$\prod_{k=1}^n (1 + a_k) = 1 + \sum_{j=1}^n \sum_{1 \leq k_1 < k_2 < \cdots < k_j \leq n} a_{k_1} a_{k_2} \cdots a_{k_j}.$$

在这一展开式中把 a_k 换成 $-a_k$ 然后移项可得

$$1 - \prod_{k=1}^n (1 - a_k) = \sum_{j=1}^n (-1)^{j-1} \sum_{1 \leq k_1 < k_2 < \cdots < k_j \leq n} a_{k_1} a_{k_2} \cdots a_{k_j}.$$

将这第二个展开式用于 $a_k = \mathbf{1}_{E_k}(x)$ 并用特征函数基本性质

$$\begin{aligned} \mathbf{1}_{\bigcup_{k=1}^n E_k}(x) &= 1 - \prod_{k=1}^n (1 - \mathbf{1}_{E_k}(x)), \\ \mathbf{1}_{E_{k_1}}(x) \mathbf{1}_{E_{k_2}}(x) \cdots \mathbf{1}_{E_{k_j}}(x) &= \mathbf{1}_{E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_j}}(x) \end{aligned}$$

得到

$$\mathbf{1}_{\bigcup_{k=1}^n E_k}(x) = \sum_{j=1}^n (-1)^{j-1} \sum_{1 \leq k_1 < k_2 < \cdots < k_j \leq n} \mathbf{1}_{E_{k_1} \cap E_{k_2} \cap \cdots \cap E_{k_j}}(x).$$

对这等式两边乘以 $f(x)$ 并在 $E = \bigcup_{k=1}^n E_k$ 上积分即得所证积分等式. 注意由 f 在 E 上可积知上述所有积分都有限, 因此运算是合法的. \square

如何从函数在某类子集上的可积性推测函数在全集上的可积性? 下面这个定理给出了一个常用的方法.

【定理2.2.5(积分的扩张)】 设 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 是一列单调增加的可测集:

$$E_1 \subset E_2 \subset E_3 \subset \cdots; \quad E := \bigcup_{k=1}^{\infty} E_k.$$

设 f 是 E 上的可测函数. 则

$$f \in L^1(E) \iff \sup_{k \geq 1} \int_{E_k} |f(x)| dx < \infty.$$

此外当 $f \in L^1(E)$ 时有

$$\int_E f(x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_k} f(x) dx.$$

【证】若 f 在 E 上可积, 则由非负函数积分的单调性 $\int_{E_k} |f| dx \leq \int_E |f| dx$ 有

$$\sup_{k \geq 1} \int_{E_k} |f(x)| dx \leq \int_E |f(x)| dx < \infty.$$

反之假设 $\sup_{k \geq 1} \int_{E_k} |f(x)| dx < \infty$. 将非负可测函数的积分扩张定理分别应用于 f 的正部和负部并注意显然的不等式 $0 \leq f^\pm(x) \leq |f(x)|$, 得到

$$\int_E f^\pm(x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_k} f^\pm(x) dx \leq \sup_{k \geq 1} \int_{E_k} |f(x)| dx < \infty.$$

因此 f 在 E 上可积. 同时对 f 在 E 上可积的情形我们还得到

$$\begin{aligned} \int_E f dx &= \int_E f^+ dx - \int_E f^- dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_k} f^+ dx - \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_k} f^- dx \\ &= \lim_{k \rightarrow \infty} \left(\int_{E_k} f^+ dx - \int_{E_k} f^- dx \right) = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_k} f dx. \end{aligned} \quad \square$$

【定理2.2.6(积分的收缩)】设 $E_k \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 是一列单调减少的可测集:

$$E_1 \supset E_2 \supset E_3 \supset \cdots; \quad E := \bigcap_{k=1}^{\infty} E_k.$$

设 $f \in L^1(E_1)$. 则有

$$\int_E f(x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E_k} f(x) dx.$$

【证】留为练习(课堂抽查). 至少有两种证法. \square

下面这个定理及其推论揭示了可积函数的一个自然性质: 积分 $E \mapsto \int_E f(x) dx$ 关于积分集 E 是连续的: 集合的测度越小, 其上积分越小.

【定理2.2.7(积分的绝对连续性)】设 $E \in \mathcal{M} = \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f \in L^1(E)$. 则对任意 $\varepsilon > 0$, 存在 $\delta > 0$, 当可测子集 $A \subset E$ 满足 $m(A) < \delta$ 时

$$\left| \int_A f(x) dx \right| \leq \int_A |f(x)| dx < \varepsilon.$$

[第一个不等式是已知性质. 第二个不等式体现了 “绝对” 的意义.]

【证】 在上面重要例题中我们已证明

$$\int_{E(|f|>M)} |f(x)|dx \rightarrow 0 \quad (M \rightarrow +\infty).$$

因此对任意 $\varepsilon > 0$ 存在 $0 < M < \infty$ 使得

$$\int_{E(|f|>M)} |f(x)|dx < \varepsilon/2.$$

取 $\delta = \varepsilon/(2M)$, 则对任意可测子集 $A \subset E$ 满足 $m(A) < \delta$ 有

$$\begin{aligned} \int_A |f(x)|dx &= \int_{A(|f|\leq M)} |f(x)|dx + \int_{A(|f|>M)} |f(x)|dx \\ &\leq \int_{A(|f|\leq M)} Mdx + \int_{E(|f|>M)} |f(x)|dx \\ &\leq Mm(A) + \varepsilon/2 < M\delta + \varepsilon/2 = \varepsilon. \end{aligned} \quad \square$$

下面这个定理是积分绝对连续性的另一表述, 其中集合 A_k 通常取成使被积函数 f 在 A_k 上具有某种较好的性质的集合.

【定理2.2.8(积分的连续性)】 设 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f \in L^1(E)$, A, A_k 是 E 中的可测子集. 令 $A_k \Delta A := (A_k \setminus A) \cup (A \setminus A_k)$. 则

$$\text{当 } m(A_k \Delta A) \rightarrow 0 \text{ (} k \rightarrow \infty \text{) 时 } \int_{A_k} f(x)dx \rightarrow \int_A f(x)dx \quad (k \rightarrow \infty).$$

【证】 由 $\int_{A_k} = \int_{A_k \setminus A} + \int_{A_k \cap A}$, $\int_A = \int_{A \setminus A_k} + \int_{A_k \cap A}$ 和积分的绝对连续性得到

$$\left| \int_{A_k} f dx - \int_A f dx \right| \leq \int_{A_k \setminus A} |f| dx + \int_{A \setminus A_k} |f| dx = \int_{A_k \Delta A} |f| dx \rightarrow 0 \quad (k \rightarrow \infty).$$

□

• L^p 空间及其完备性 Lebesgue 积分理论的一个主要优点是完备性.

设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 对于常数 $1 \leq p < \infty$ 定义

$$L^p(E) := \left\{ f : E \rightarrow [-\infty, +\infty] \text{ } L\text{-可测} \mid \int_E |f(x)|^p dx < \infty \right\}.$$

在 $L^p(E)$ 上定义范数 $\| \cdot \|_{L^p} = \| \cdot \|_{L^p(E)}$ 为

$$\|f\|_{L^p} = \|f\|_{L^p(E)} := \left(\int_E |f(x)|^p dx \right)^{1/p}, \quad f \in L^p(E).$$

需说明 $L^p(E)$ 是一个实线性赋范空间: 首先注意, 在 $L^p(E)$ 中, 相等 “=” 的定义是

$$f = g \quad \text{in } L^p(E) \quad \Longleftrightarrow \quad f(x) = g(x) \quad \text{a.e. } x \in E.$$

也即把两个几乎处处相等的函数视为同一个函数. 这等价于说

$$f = g \quad \text{in } L^p(E) \quad \Longleftrightarrow \quad \|f - g\|_{L^p} = 0.$$

由此立即看出: 这样定义的相等 “=” 确实是 $L^p(E)$ 上的一个等价关系, 所以它是合理的、与通常的相等是相容的. 【粗略地说, 这不过是说零测集对积分无贡献, 而在 $L^p(E)$ 中, 一切都是从积分考虑的.】

来看: 若 $f, g \in L^p(E)$. 则 f, g 几乎处处有限. 因此 $f + g$ 在 E 上可测. 因 $1 \leq p < \infty$ 故函数 $t \mapsto t^p$ 在 $[0, +\infty)$ 上为凸函数, 从而有 $(\frac{a+b}{2})^p \leq \frac{1}{2}(a^p + b^p)$ 即 $(a + b)^p \leq 2^{p-1}(a^p + b^p) (\forall a, b \in [0, +\infty))$. 于是对于几乎所有 $x \in E$ 有

$$|f(x) + g(x)|^p \leq (|f(x)| + |g(x)|)^p \leq 2^{p-1}(|f(x)|^p + |g(x)|^p).$$

这蕴涵 $f + g \in L^p(E)$. 此外对任意常数 $\alpha \in \mathbb{R}$ 有 $|\alpha f|^p = |\alpha|^p |f|^p$. 所以 $\alpha f \in L^p(E)$. 这证明了 $L^p(E)$ 是一个实线性空间.

其次来证明 $\|\cdot\|_{L^p}$ 确实是 $L^p(E)$ 上的一个范数从而 $L^p(E)$ 是一个实线性赋范空间。由范数的定义, 需证明 $\|\cdot\|_{L^p}$ 满足下面关于范数的三个规定性质(i)-(iii):

(i) 正定性:

$$\|f\|_{L^p} \geq 0 \quad \forall f \in L^p(E); \quad \|f\|_{L^p} = 0 \quad \Longleftrightarrow \quad f = 0.$$

(ii) 正齐次性:

$$\|\alpha f\|_{L^p} = |\alpha| \|f\|_{L^p} \quad \forall f \in L^p(E), \forall \alpha \in \mathbb{R}.$$

(iii) 三角不等式:

$$\|f + g\|_{L^p} \leq \|f\|_{L^p} + \|g\|_{L^p} \quad f, g \in L^p(E).$$

第(i),(ii)条是显然的, 第(iii)条是主要性质, 我们把它和另一常用不等式(Hölder不等式)列为一个定理:

【定理2.2.9(Hölder不等式和三角不等式)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$.

(a) 设 $1 < p, q < \infty$ 满足 $1/p + 1/q = 1$. 设 $f \in L^p(E), g \in L^q(E)$. 则乘积 $fg \in L^1(E)$ 且成立Hölder不等式:

$$\|fg\|_{L^1} \leq \|f\|_{L^p} \|g\|_{L^q}.$$

即

$$\int_E |f(x)g(x)|dx \leq \left(\int_E |f(x)|^p dx \right)^{1/p} \left(\int_E |g(x)|^q dx \right)^{1/q}.$$

当 $p = q = 2$ 时, Hölder 不等式称为**Cauchy-Schwarz不等式**: 即若 $f, g \in L^2(E)$ 则 $fg \in L^1(E)$ 且

$$\|fg\|_{L^1} \leq \|f\|_{L^2} \|g\|_{L^2}.$$

即

$$\int_E |f(x)g(x)|dx \leq \left(\int_E |f(x)|^2 dx \right)^{1/2} \left(\int_E |g(x)|^2 dx \right)^{1/2}.$$

(b) 设 $f, g \in L^p(E), 1 \leq p < \infty$. 则成立三角不等式(也称为Minkowski不等式):

$$\|f + g\|_{L^p} \leq \|f\|_{L^p} + \|g\|_{L^p}.$$

即

$$\left(\int_E |f(x) + g(x)|^p dx \right)^{1/p} \leq \left(\int_E |f(x)|^p dx \right)^{1/p} + \left(\int_E |g(x)|^p dx \right)^{1/p}.$$

【证】(a): 若例如 $\|f\|_{L^p} = 0$, 则有 $\int_E |f(x)|^p dx = 0$ 从而有 $f(x) = 0$ a.e. $x \in E$. 这蕴含 $f(x)g(x) = 0$ a.e. $x \in E$. 因此 $\|fg\|_{L^1} = 0$. 此时Hölder 不等式显然成立。设 $\|f\|_{L^p} > 0, \|g\|_{L^q} > 0$. 令

$$f_1(x) = \frac{|f(x)|}{\|f\|_{L^p}}, \quad g_1(x) = \frac{|g(x)|}{\|g\|_{L^q}}.$$

则由Young不等式

$$AB \leq \frac{A^p}{p} + \frac{B^q}{q} \quad \forall 0 \leq A, B \leq +\infty.$$

有

$$f_1(x)g_1(x) \leq \frac{f_1(x)^p}{p} + \frac{g_1(x)^q}{q}, \quad x \in E$$

取积分得到

$$\frac{1}{\|f\|_{L^p} \|g\|_{L^q}} \int_E |f(x)g(x)|dx = \int_E f_1(x)g_1(x)dx$$

$$\begin{aligned}
&\leq \frac{1}{p} \int_E f_1(x)^p dx + \frac{1}{q} \int_E g_1(x)^q dx \\
&= \frac{1}{p} \cdot \frac{\int_E |f(x)|^p dx}{(\|f\|_{L^p})^p} + \frac{1}{q} \cdot \frac{\int_E |g(x)|^q dx}{(\|g\|_{L^q})^q} = \frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1.
\end{aligned}$$

不等式两边乘以 $\|f\|_{L^p}\|g\|_{L^q}$ 即得 Hölder 不等式.

(b): 当 $p = 1$ 时, 这是已证的积分不等式(由 $|f(x) + g(x)| \leq |f(x)| + |g(x)|$ 推出).

设 $1 < p < \infty$. 考虑分拆

$$|f(x) + g(x)|^p = |f(x) + g(x)| |f(x) + g(x)|^{p-1} \leq |f(x)| |f(x) + g(x)|^{p-1} + |g(x)| |f(x) + g(x)|^{p-1}.$$

设 $1 < q < \infty$ 为 p 的相伴数, 即满足 $1/p + 1/q = 1$, 即 $q = \frac{p}{p-1}$. 则由 Hölder 不等式有

$$\begin{aligned}
\int_E |f(x)| |f(x) + g(x)|^{p-1} dx &\leq \left(\int_E |f(x)|^p dx \right)^{1/p} \left(\int_E |f(x) + g(x)|^{(p-1)q} dx \right)^{1/q} \\
&= \|f\|_{L^p} \left(\int_E |f(x) + g(x)|^p dx \right)^{1/q} = \|f\|_{L^p} (\|f + g\|_{L^p})^{p-1} = \|f\|_{L^p} (\|f + g\|_{L^p})^{p-1}.
\end{aligned}$$

同样有

$$\int_E |g(x)| |f(x) + g(x)|^{p-1} dx \leq \|g\|_{L^p} (\|f + g\|_{L^p})^{p-1}.$$

因此

$$(\|f + g\|_{L^p})^p = \int_E |f(x) + g(x)|^p dx \leq (\|f\|_{L^p} + \|g\|_{L^p}) (\|f + g\|_{L^p})^{p-1}.$$

当 $\|f + g\|_{L^p} > 0$ 时, 两边除以 $(\|f + g\|_{L^p})^{p-1}$ 即得三角不等式. 而当 $\|f + g\|_{L^p} = 0$ 时, 三角不等式显然成立. \square

应用归纳法易见三角不等式可推广成多角不等式:

$$\left\| \sum_{k=1}^n f_k \right\|_{L^p} \leq \sum_{k=1}^n \|f_k\|_{L^p}, \quad f_k \in L^p(E), \quad k = 1, 2, \dots, n.$$

进一步推广到无穷和也是可能的只要具有某种收敛性. 这就是下面定理的内容.

【定理2.2.10】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $1 \leq p < \infty$, 函数列 $\{u_k\}_{k=1}^\infty \subset L^p(E)$ 满足

$$\sum_{k=1}^\infty \|u_k\|_{L^p} < \infty.$$

则函数级数

$$\sum_{k=1}^{\infty} u_k(x), \quad x \in E$$

在 E 上几乎处处绝对收敛, 和函数 $\sum_{k=1}^{\infty} u_k \in L^p(E)$, 并有

$$\left\| \sum_{k=1}^{\infty} u_k \right\|_{L^p} \leq \sum_{k=1}^{\infty} \|u_k\|_{L^p}, \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \left\| \sum_{k=n+1}^{\infty} u_k \right\|_{L^p} = 0.$$

【证】从非负函数下手总是方便且安全的. 考虑非负函数级数

$$\sum_{k=1}^{\infty} |u_k(x)|, \quad x \in E.$$

它显然在 E 上可测:

$$\sum_{k=1}^n |u_k(x)| \nearrow \sum_{k=1}^{\infty} |u_k(x)| \quad (k \rightarrow \infty) \quad \forall x \in E.$$

由此有

$$\left(\sum_{k=1}^n |u_k(x)| \right)^p \nearrow \left(\sum_{k=1}^{\infty} |u_k(x)| \right)^p \quad (k \rightarrow \infty) \quad \forall x \in E.$$

因此由Levi单调收敛定理有

$$\int_E \left(\sum_{k=1}^{\infty} |u_k(x)| \right)^p dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_E \left(\sum_{k=1}^n |u_k(x)| \right)^p dx.$$

另一方面, 由范数的三角不等式我们计算

$$\int_E \left(\sum_{k=1}^n |u_k(x)| \right)^p dx = \left(\left\| \sum_{k=1}^n |u_k| \right\|_{L^p} \right)^p \leq \left(\sum_{k=1}^n \|u_k\|_{L^p} \right)^p \leq \left(\sum_{k=1}^{\infty} \|u_k\|_{L^p} \right)^p$$

$n = 1, 2, 3, \dots$ 因此

$$\int_E \left(\sum_{k=1}^{\infty} |u_k(x)| \right)^p dx \leq \left(\sum_{k=1}^{\infty} \|u_k\|_{L^p} \right)^p < \infty.$$

这证明了 $\left(\sum_{k=1}^{\infty} |u_k| \right)^p$ 在 E 上可积也即 $\sum_{k=1}^{\infty} |u_k| \in L^p(E)$. 由此可知 $\left(\sum_{k=1}^{\infty} |u_k(x)| \right)^p$ 在 E 上几乎处处有限从而 $\sum_{k=1}^{\infty} |u_k(x)|$ 在 E 上几乎处处有限: $\sum_{k=1}^{\infty} |u_k(x)| < \infty \quad \forall x \in E \setminus Z$ 其中 Z 是一个零测集. 如将每个 $u_k(x)$ 在 $x \in Z$ 处重新定义为 $u_k(x) = 0$, 则根据 L^p 中相等的定义可知 u_k 与修正前的 u_k 几乎处处相等, 因此它们在 $L^p(E)$ 中相等 ($k = 1, 2, 3, \dots$). 于是 $\sum_{k=1}^{\infty} u_k(x)$ 在 E 上处处绝对收敛. 再由 $\left| \sum_{k=1}^{\infty} u_k(x) \right| \leq \sum_{k=1}^{\infty} |u_k(x)|$ 可知 $\sum_{k=1}^{\infty} u_k \in L^p(E)$ 且

$$\left\| \sum_{k=1}^{\infty} u_k \right\|_{L^p} \leq \left\| \sum_{k=1}^{\infty} |u_k| \right\|_{L^p} \leq \sum_{k=1}^{\infty} \|u_k\|_{L^p}.$$

对函数级数 $\sum_{k=n+1}^{\infty} u_k(x)$, 照搬上面推导同样有

$$\left\| \sum_{k=n+1}^{\infty} u_k \right\|_{L^p} \leq \sum_{k=n+1}^{\infty} \|u_k\|_{L^p} \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty)$$

其中的零极限是因为收敛的级数的尾巴趋于零. \square

【定理2.2.11(L^p 空间的完备性)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $1 \leq p < \infty$.

则 $L^p(E)$ 按距离 $\|f - g\|_{L^p}$ 是完备的, 即: 若序列 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 是 $L^p(E)$ 中的 Cauchy 列, 也即 $\lim_{n \rightarrow \infty, k \rightarrow \infty} \|f_n - f_k\|_{L^p} = 0$, 则 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 在 $L^p(E)$ 中收敛, 即存在 $f \in L^p(E)$ 使得

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \|f_k - f\|_{L^p} = 0.$$

这个收敛简记作 $f_k \rightarrow f$ in L^p .

【证】 设 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 是 $L^p(E)$ 中的 Cauchy 列. 则由 Cauchy 列的定义易见 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 在 $L^p(E)$ 中有界, 即

$$\sup_{k \in \mathbb{N}} \|f_k\|_{L^p} < \infty.$$

此外由可积蕴含几乎处处有限知 f_k 都在 E 上几乎处处有限. 下证存在 $f \in L^p(E)$ 使得 $\lim_{k \rightarrow \infty} \|f_k - f\|_{L^p} = 0$.

[证法1]. 对任意 $\varepsilon > 0$ 有

$$m(E(|f_n - f_k| \geq \varepsilon)) \leq \int_{E(|f_n - f_k| \geq \varepsilon)} \frac{|f_n(x) - f_k(x)|^p}{\varepsilon^p} dx \leq \frac{1}{\varepsilon^p} \int_E |f_n(x) - f_k(x)|^p dx$$

即

$$m(E(|f_n - f_k| \geq \varepsilon)) \leq \frac{1}{\varepsilon^p} (\|f_n - f_k\|_{L^p})^p.$$

因右边趋于零当 $n, k \rightarrow \infty$, 故 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 是依测度 Cauchy 列. 据 **命题1.8.1(依测度收敛的Cauchy准则)**, E 上存在几乎处处有限的可测函数 f 使得 f_k 在 E 上依测度收敛于 f . 再由 **Riesz 定理** 知则存在 $\{f_k\}_{k=1}^{\infty}$ 的子列 $\{f_{k_n}\}_{n=1}^{\infty}$ 使得 f_{k_n} 在 E 上几乎处处收敛于 f , 即

$$\lim_{n \rightarrow \infty} f_{k_n}(x) = f(x) \quad \text{a.e. } x \in E.$$

注意这蕴含

$$\lim_{n \rightarrow \infty} |f_{k_n}(x)|^p = |f(x)|^p \quad \text{a.e. } x \in E.$$

于是由**Fatou 引理** 有

$$\int_E |f(x)|^p dx \leq \liminf_{n \rightarrow \infty} \int_E |f_{k_n}(x)|^p dx \leq \left(\sup_{k \in \mathbb{N}} \|f_k\|_{L^p} \right)^p < \infty.$$

这表明 $f \in L^p(E)$. 同理对任意 $k \in \mathbb{N}$ 有

$$\lim_{n \rightarrow \infty} |f_k(x) - f_{k_n}(x)|^p = |f_k(x) - f(x)|^p \quad \text{a.e. } x \in E.$$

从而再由**Fatou 引理** 有

$$\int_E |f_k(x) - f(x)|^p dx \leq \liminf_{n \rightarrow \infty} \int_E |f_k(x) - f_{k_n}(x)|^p dx.$$

对任意 $\varepsilon > 0$, 存在 $N \in \mathbb{N}$ 使得当 $k, n \geq N$ 时 $\|f_k - f_n\|_{L^p} < \varepsilon$. 于是当 $k \geq N$ 时有

$$\int_E |f_k(x) - f(x)|^p dx \leq \liminf_{n \rightarrow \infty} \int_E |f_k(x) - f_{k_n}(x)|^p dx \leq \varepsilon^p.$$

因此当 $k \geq N$ 时有 $\|f_k - f\|_{L^p} \leq \varepsilon$. 所以 $\lim_{k \rightarrow \infty} \|f_k - f\|_{L^p} = 0$.

[证法2]. 因可积蕴涵几乎处处有限, 故 $Z_0 = \bigcup_{k=1}^{\infty} E(|f_k| = \infty)$ 是零测集. 因此以 $E \setminus Z_0$ 代替 E 我们可以假定所有 f_k 在 E 上处处有限. 这使得下面涉及的函数运算处处有意义. 由 Cauchy 列的定义易见存在子列 $\{f_{k_j}\}_{j=1}^{\infty}$ (即 $1 \leq k_1 < k_2 < k_3 < \dots$) 使得

$$\|f_{k_j} - f_{k_{j-1}}\|_{L^p} \leq \frac{1}{2^{j-1}}, \quad j = 2, 3, 4, \dots$$

这蕴含

$$\|f_{k_1}\|_{L^p} + \sum_{j=2}^{\infty} \|f_{k_j} - f_{k_{j-1}}\|_{L^p} \leq \|f_{k_1}\|_{L^p} + \sum_{j=2}^{\infty} \frac{1}{2^{j-1}} < \infty.$$

将上述**定理2.2.10** 应用于函数列

$$u_1 = f_{k_1}, \quad u_j = f_{k_j} - f_{k_{j-1}}, \quad j = 2, 3, 4, \dots$$

可知和函数

$$f(x) := \sum_{j=1}^{\infty} u_j(x) = f_{k_1}(x) + \sum_{j=2}^{\infty} [f_{k_j}(x) - f_{k_{j-1}}(x)], \quad x \in E$$

在 E 上几乎处处绝对收敛, 并且 $f \in L^p(E)$ 以及有

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \left\| \sum_{j=n+1}^{\infty} [f_{k_j} - f_{k_{j-1}}] \right\|_{L^p} = \lim_{n \rightarrow \infty} \left\| \sum_{j=n+1}^{\infty} u_j \right\|_{L^p} = 0.$$

对任意 $n(\geq 2)$ 有

$$f_{k_1}(x) + \sum_{j=2}^n [f_{k_j}(x) - f_{k_{j-1}}(x)] = f_{k_n}(x).$$

因此由级数收敛的定义有

$$f(x) = f_{k_1}(x) + \sum_{j=1}^{\infty} [f_{k_j}(x) - f_{k_{j-1}}(x)] = f_{k_n}(x) + \sum_{j=n+1}^{\infty} [f_{k_j}(x) - f_{k_{j-1}}(x)]$$

$x \in E \setminus Z$, 也即

$$f(x) - f_{k_n}(x) = \sum_{j=n+1}^{\infty} [f_{k_j}(x) - f_{k_{j-1}}(x)], \quad x \in E \setminus Z$$

其中 Z 为一个零测集: $m(Z) = 0$. 因此有

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \|f - f_{k_n}\|_{L^p} = \lim_{n \rightarrow \infty} \left\| \sum_{j=n+1}^{\infty} [f_{k_j} - f_{k_{j-1}}] \right\|_{L^p} = 0.$$

注意到 $k_n \geq n$, $n = 1, 2, 3, \dots$, 以及 $\{f_n\}_{n=1}^{\infty}$ 为 Cauchy 列得到

$$\|f - f_n\|_{L^p} \leq \|f - f_{k_n}\|_{L^p} + \|f_{k_n} - f_n\|_{L^p} \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty).$$

换回记号 f_k , 这就是 $\lim_{k \rightarrow \infty} \|f - f_k\|_{L^p} = 0$. \square

【注1】 定理2.2.10的证明和定理2.2.11的证法2 具有一般性, 将来在学习泛函分析时会遇到类似的论证: 对于一个赋范线性空间 $(X, \|\cdot\|)$ 来说, X 是完备的当且仅当数值级数 $\sum_{k=1}^{\infty} \|x_k\|$ 收敛蕴涵级数 $\sum_{k=1}^{\infty} x_k$ 在 $(X, \|\cdot\|)$ 中收敛.

【注2】 在定理2.2.11 的证明中我们实际上还证明了下面的

【Riesz 定理】 设 $1 \leq p < \infty$ 且若 $\|f_n - f\|_{L^p(E)} \rightarrow 0$ ($n \rightarrow \infty$), 则存在子列 $\{f_{n_k}\}_{k=1}^{\infty}$ 使得 $f_{n_k} \rightarrow f$ ($k \rightarrow \infty$) a.e. 于 E . \square

一个自然的问题是: 能否证明实际上是全序列几乎处处收敛?, 即能否证明 $f_n \rightarrow f$ ($n \rightarrow \infty$) a.e. 于 E ?

下面的例子表明, “子序列” 一般不能换成 “全序列”。

【重要例题】 设 $1 \leq p < \infty$. 则有函数列 $f, f_n \in L^p([0, 1]^d)$ 满足 $\|f_n - f\|_{L^p} \rightarrow 0$ ($n \rightarrow \infty$), 使得 f_n 在 $[0, 1]^d$ 上处处不收敛于 f .

只需考虑 $f(x) \equiv 0$ 的情形. 设 S 为 $[0, 1]^d$ 中的左闭右开的2-进方体族:

$$S = \left\{ \prod_{i=1}^d \left[\frac{j_i - 1}{2^k}, \frac{j_i}{2^k} \right) \mid j_i = 1, 2, \dots, 2^k, i = 1, 2, \dots, d, k \in \mathbb{N} \right\} = \bigcup_{k=1}^{\infty} S_k$$

其中

$$S_k = \left\{ \prod_{i=1}^d \left[\frac{j_i - 1}{2^k}, \frac{j_i}{2^k} \right) \mid j_i = 1, 2, \dots, 2^k, i = 1, 2, \dots, d \right\}, \quad k \in \mathbb{N}.$$

易见 S_k 的元素个数为 2^{kd} 且有

$$m(Q) = \frac{1}{2^{kd}}, \quad Q \in S_k.$$

将 S 中的元素按下面方式排成一列: $S = \{Q_1, Q_2, Q_3, \dots, Q_n, \dots\}$:

$$\begin{aligned} S_1 &= \{Q_1, Q_2, \dots, Q_{2^d}\}, \quad S_2 = \{Q_{2^d+1}, Q_{2^d+2}, \dots, Q_{2^d+2^{2d}}\}, \quad \dots, \\ S_k &= \{Q_{2^d+2^{2d}+\dots+2^{(k-1)d}+1}, Q_{2^d+2^{2d}+\dots+2^{(k-1)d}+2}, \dots, Q_{2^d+2^{2d}+\dots+2^{(k-1)d}+2^{kd}}\}, \\ k &= 2, 3, 4, \dots \end{aligned}$$

令

$$f_n(x) = \mathbf{1}_{Q_n}(x), \quad Q_n \in S, \quad n = 1, 2, 3, \dots,$$

则对任意 $n > 2^d$, 存在唯一的 $2 \leq k \in \mathbb{N}$ 使得 $2^d + 2^{2d} + \dots + 2^{(k-1)d} + 1 \leq n \leq 2^d + 2^{2d} + \dots + 2^{(k-1)d} + 2^{kd}$, 因此 $Q_n \in S_k$. 这给出 $n < 2^{(k+1)d}$,

$$(\|f_n\|_{L^p})^p = \int_{[0,1]^d} (f_n(x))^p dx = m(Q_n) = \frac{1}{2^{kd}} < \frac{2^d}{n}.$$

其中用到 $(\mathbf{1}_{Q_n}(x))^p = \mathbf{1}_{Q_n}(x)$. 这表明 $\|f_n\|_{L^p} \rightarrow 0$ ($n \rightarrow \infty$).

下证对任意 $x \in [0, 1]^d$ 有 $f_n(x) \not\rightarrow 0$ ($n \rightarrow \infty$). 事实上对任意 $x = (x_1, x_2, \dots, x_d) \in [0, 1]^d$, 对每个 $i \in \{1, 2, \dots, d\}$ 和每个 $k \in \mathbb{N}$, 由 $[0, 1) = \bigcup_{j=1}^{2^k} [\frac{j-1}{2^k}, \frac{j}{2^k})$ 知存在 $j = j_i \in \{1, 2, \dots, 2^k\}$ 使得 $x_i \in [\frac{j_i-1}{2^k}, \frac{j_i}{2^k})$. 于是

$$x = (x_1, x_2, \dots, x_d) \in \prod_{i=1}^d \left[\frac{j_i - 1}{2^k}, \frac{j_i}{2^k} \right) =: Q_{n_k} \in S_k, \quad k = 2, 3, 4, \dots$$

由 S_k 的上述编号知

$$n_k \in \{2^d + 2^{2d} + \dots + 2^{(k-1)d} + 1, 2^d + 2^{2d} + \dots + 2^{(k-1)d} + 2, \dots, 2^d + 2^{2d} + \dots + 2^{(k-1)d} + 2^{kd}\}.$$

这蕴含当 $k \rightarrow \infty$ 时 $n_k \rightarrow \infty$. 而由 $x \in \bigcap_{k=2}^{\infty} Q_{n_k}$ 知 $f_{n_k}(x) = \mathbf{1}_{Q_{n_k}}(x) = 1, k = 2, 3, 4, \dots$. 因此 $f_n(x) \not\rightarrow 0$ ($n \rightarrow \infty$). 这证明了 f_n 在 $[0, 1]^d$ 上处处不趋于0. \square

强调: 积分 $\int_E f(x)dx$ 是由被积函数 f 和积分集 E 这两个因素决定, 因此在估算积分时要同时考虑这两点, 特别对于初学者来说更要注意对积分集 E 的分解。

【例】设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $m(E) < \infty$, 设 E 上的可测函数列 $\{f_n\}_{n=1}^\infty$ 一致有界: $|f_n(x)| \leq M$, $x \in E, n = 1, 2, 3, \dots$ 其中 M 为有限常数. 假设当 $n \rightarrow \infty$ 时 f_n 依测度收敛于函数 f , 证明 f_n 按 L^1 范数收敛于 f , 即 $\|f_n - f\|_{L^1} = \int_E |f_n(x) - f(x)| dx \rightarrow 0$ ($n \rightarrow \infty$).

【证】首先由 Riesz 定理知存在子列 $\{f_{n_j}\}_{j=1}^\infty$ 使得 $f_{n_j}(x) \rightarrow f(x)$ ($j \rightarrow \infty$) a.e. $x \in E$. 由此有 $|f(x)| = \lim_{j \rightarrow \infty} |f_{n_j}(x)| \leq M$ a.e. $x \in E$. 由于零测集不影响积分, 故可以假设 $|f(x)| \leq M$ for all $x \in E$. 下面给出两种证法.

[证法1] 对任意 $\varepsilon > 0$ 考虑分解

$$\begin{aligned} \int_E |f_n(x) - f(x)| dx &= \int_{E(|f_n - f| < \varepsilon)} |f_n(x) - f(x)| dx + \int_{E(|f_n - f| \geq \varepsilon)} |f_n(x) - f(x)| dx \\ &\leq \int_{E(|f_n - f| < \varepsilon)} \varepsilon dx + \int_{E(|f_n - f| \geq \varepsilon)} 2M dx = \varepsilon m(E(|f_n - f| < \varepsilon)) + 2M m(E(|f_n - f| \geq \varepsilon)) \\ &\leq \varepsilon m(E) + 2M m(E(|f_n - f| \geq \varepsilon)) \\ \implies \limsup_{n \rightarrow \infty} \|f_n - f\|_{L^1} &\leq \varepsilon m(E) + 2M \limsup_{n \rightarrow \infty} m(E(|f_n - f| \geq \varepsilon)) = \varepsilon m(E). \end{aligned}$$

由 $m(E) < \infty$ 和 ε 的任意性(或者令 $\varepsilon \rightarrow 0+$) 即知 $\limsup_{n \rightarrow \infty} \|f_n - f\|_{L^1} = 0$. 所以 f_n 在 E 上按 L^1 范数收敛到 f .

[证法2] 回忆实数理论: 任何实数序列的上(下)极限等于该数列的某个子列的极限. 据此知存在子列 $\{n_k\}_{k=1}^\infty$ 使得

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \|f_{n_k} - f\|_{L^1} = \limsup_{n \rightarrow \infty} \|f_n - f\|_{L^1}.$$

对函数列 $\{f_{n_k}\}_{k=1}^\infty$ (它当然依测度收敛于 f), 由 Riesz 定理知存在子列 $\{f_{n_{k_j}}\}_{j=1}^\infty$ 使得 $f_{n_{k_j}}(x) \rightarrow f(x)$ ($j \rightarrow \infty$) a.e. $x \in E$. 于是有

$$\lim_{j \rightarrow \infty} |f_{n_{k_j}}(x) - f(x)| = 0 \quad \text{a.e. } x \in E; \quad \sup_{j \in \mathbb{N}, x \in E} |f_{n_{k_j}}(x) - f(x)| \leq M.$$

因 $m(E) < \infty$, 故由 Lebesgue 有界收敛定理知

$$\lim_{j \rightarrow \infty} \int_E |f_{n_{k_j}}(x) - f(x)| dx = 0 \quad \text{i.e.} \quad \lim_{j \rightarrow \infty} \|f_{n_{k_j}} - f\|_{L^1} = 0.$$

所以

$$\limsup_{n \rightarrow \infty} \|f_n - f\|_{L^1} = \lim_{k \rightarrow \infty} \|f_{n_k} - f\|_{L^1} \lim_{j \rightarrow \infty} \|f_{n_{k_j}} - f\|_{L^1} = 0. \quad \square$$

• **复值函数和实向量值函数的积分.** 有了实值可测函数和积分的定义以及基本性质便可以定义复值函数和实向量值函数的可测性和可积性并得到相关性质.

【定义(复值可测函数和积分)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f = \operatorname{Re}(f) + i\operatorname{Im}(f) : E \rightarrow \mathbb{C}$ 其中 $\operatorname{Re}(f), \operatorname{Im}(f)$ 是 f 的实部和虚部, $i = \sqrt{-1}$.

若 $\operatorname{Re}(f), \operatorname{Im}(f)$ 都在 E 上可测, 则称 f 在 E 上可测.

若 $\operatorname{Re}(f), \operatorname{Im}(f)$ 都在 E 上可积, 即 $\operatorname{Re}(f), \operatorname{Im}(f) \in L^1(E)$, 则称 f 在 E 上可积, 记作 $f \in L^1(E)$, 并定义 f 在 E 上的积分为

$$\int_E f(x)dx = \int_E \operatorname{Re}(f(x))dx + i \int_E \operatorname{Im}(f(x))dx. \quad \square$$

【定义(向量值可测函数和积分)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f = (f_1, f_2, \dots, f_n) : E \rightarrow \mathbb{R}^d$.

若 f 的每个坐标函数 f_1, f_2, \dots, f_n 都在 E 上可测, 则称 f 在 E 上可测.

若 f 的每个坐标函数 f_1, f_2, \dots, f_n 都在 E 上可积, 即 $f_1, f_2, \dots, f_n \in L^1(E)$, 则称 f 在 E 上可积, 并定义 f 在 E 上的积分为

$$\int_E f(x)dx = \left(\int_E f_1(x)dx, \int_E f_2(x)dx, \dots, \int_E f_n(x)dx \right). \quad \square$$

【注】 在复值函数 f 的可测性和可积性定义中我们要求 f 的实部和虚部都属于 \mathbb{R} 即他们处处有限. 这是因为我们不打算处理 $a + i\infty, \infty + ib, \infty + i\infty$, etc. 的情形. 对向量值的情形也同样不考虑向量的某些分量是 $\pm\infty$ 的情形.

下面命题给出复值和向量值函数积分的基本不等式.

【命题2.2.12】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$. 若复值函数 $f : E \rightarrow \mathbb{C}$ 或向量值函数 $f : E \rightarrow \mathbb{R}^d$ 在 E 上可积, 则有

$$\left| \int_E f(x)dx \right| \leq \int_E |f(x)|dx \quad (2.2.2)$$

其中 $|\cdot|$ 是复数的模或向量的欧几里德范数.

【证】 对于向量的情形, $f = (f_1, f_2, \dots, f_n)$, 不等式(2.2.2) 详细写为

$$\left(\sum_{k=1}^n \left(\int_E f_k(x)dx \right)^2 \right)^{1/2} \leq \int_E \left(\sum_{k=1}^n (f_k(x))^2 \right)^{1/2} dx. \quad (2.2.3)$$

对于复值的情形, 如写 $f = f_1 + if_2$, 则由复数的模的定义 $|a + ib| = (a^2 + b^2)^{1/2}$ 可见, 此时(2.2.2)的详细表示等于(2.2.3)中 $n = 2$ 的情形. 因此只需证明(2.2.3), 也即只需对向量值的情形证明(2.2.2).

任取向量 $y = (y_1, y_2, \dots, y_n) \in \mathbb{R}^d$. 考虑内积并运用积分的线性性和Cauchy不等式有

$$\begin{aligned} \left\langle y, \int_E f(x) dx \right\rangle &= \sum_{k=1}^n y_k \int_E f_k(x) dx = \int_E \left(\sum_{k=1}^n y_k f_k(x) \right) dx \\ &= \int_E \langle y, f(x) \rangle dx \leq \int_E |y| |f(x)| dx = |y| \int_E |f(x)| dx. \end{aligned}$$

取

$$y = \int_E f(x) dx$$

得到

$$\left| \int_E f(x) dx \right|^2 \leq \left| \int_E f(x) dx \right| \int_E |f(x)| dx.$$

当 $\int_E f(x) dx \neq 0$ 时, 也即当 $\left| \int_E f(x) dx \right| > 0$ 时, 从上面不等式消去它即得(2.2.2). 而当 $\int_E f(x) dx = 0$ (零向量)时, (2.2.2)显然成立. \square

根据复值函数和向量值函数的积分的定义和不等式(2.2.2)易知, 前面得到的所有性质 (除了涉及大小顺序的以外) 例如线性性、可加性、逐项积分、LDC、积分的绝对连续性、 L^p 空间极其完备性, 等等对复值函数和向量值函数的情形都成立。

作业题:

1. 设实函数 $f, g \in L^1(\mathbb{R}^d)$. 则 $f \wedge g, f \vee g \in L^1(\mathbb{R}^d)$, 这里 $(f \wedge g)(x) = \min\{f(x), g(x)\}$, $(f \vee g)(x) = \max\{f(x), g(x)\}$.

2. 设 $(0, \infty)^2 = (0, \infty) \times (0, \infty)$ 上的二元函数

$$f(x, y) = -1 \quad \text{if} \quad \frac{y}{x} \in \mathbb{Q}, \quad f(x, y) = 1 \quad \text{if} \quad \frac{y}{x} \in \mathbb{R} \setminus \mathbb{Q}.$$

证明 f 在 $(0, \infty)^2$ 上可测并求 $\int_{(0,1)^2} f(x, y) dx dy = ?$

3. 设 $E \subset \mathbb{R}$ 为可测集, $0 \leq f \in L^1(E)$ 且 $\int_E f(x) dx = 1$. 证明

$$\int_E f(x) \cos(x) dx < 1.$$

4. 设 $f_n, f \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 且

$$\int_{\mathbb{R}^d} |f_n(x) - f(x)| dx \leq \frac{1}{n^2}, \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

证明 $f_n(x) \rightarrow f(x) (n \rightarrow \infty) \text{ a.e. } x \in \mathbb{R}^d$. [级数收敛蕴含其通项趋于零.]

5. 设 $f \in L^1(E)$. 证明

$$m(E(|f| > k)) = o\left(\frac{1}{k}\right) \quad (k \rightarrow \infty).$$

6. 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f \in L^1(E)$, $f_n(x) = \mathbf{1}_{E \cap B(0,n)}(x)f(x)$. 证明当 $n \rightarrow \infty$ 时 f_n 按 L^1 范数收敛于 f 从而 f_n 依测度收敛于 f .

7. (1) 设实值函数 $f \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 满足

$$\int_E f(x) dx \geq 0 \quad \forall E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d).$$

证明 $f \geq 0$ a.e. 于 \mathbb{R}^d .

(2) 若 $f \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 满足 $\int_E f(x) dx = 0 \quad \forall E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 证明 $f = 0$ a.e. $x \in \mathbb{R}^d$.

(3) 设 $f \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 满足: 对 \mathbb{R}^d 上每个有界可测函数 φ 都有

$$\int_{\mathbb{R}^d} f(x)\varphi(x) dx = 0.$$

证明 $f = 0$ a.e. 于 \mathbb{R}^d .

8. 设 $f, g \in L^1([0, \infty))$ 满足

$$\int_0^x f(t) dt = \int_0^x g(t) dt \quad \forall x > 0.$$

证明 $f = g$ a.e. 于 $[0, \infty)$.

9. 设 $f \in L^1((0, \infty))$,

$$g(x) = \int_0^\infty \frac{f(t)}{x+t} dt, \quad x \in (0, \infty).$$

证明 g 在 $(0, \infty)$ 连续且 $\lim_{x \rightarrow +\infty} g(x) = 0$.

10. 设 $f \in L^1(E)$. 证明

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_{E(|f| < 1/k)} f(x) dx = 0.$$

11. 设 $f_k, f \in L^1(E)$ 且 $\lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) = f(x)$ a.e. $x \in E$, $\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |f_k(x)| dx = \int_E |f(x)| dx$.

证明

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |f_k(x) - f(x)| dx = 0.$$

12. 设 $f: [0, 1] \rightarrow \mathbb{R}$ 为可测函数, $E = \{x \in [0, 1] \mid f(x) \in \mathbb{Z}\}$. 证明

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^1 |\cos(f(x)\pi)|^n dx = m(E).$$

13. 设 $f_k, f, g_k, g \in L^1(E)$, $M := \sup_{k \in \mathbb{N}, x \in E} |f_k(x)| < \infty$, 且
 $\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |f_k(x) - f(x)| dx = 0$, $\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |g_k(x) - g(x)| dx = 0$. 证明

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \int_E |f_k(x)g_k(x) - f(x)g(x)| dx = 0.$$

14. 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^p)$, $\Omega \subset \mathbb{R}^q$, $f(x, y)$ 为 $E \times \Omega$ 上的实值或复值函数, 满足

- (i) 对每个 $y \in \Omega$, $x \mapsto f(x, y)$ 是 E 上的可测函数,
- (ii) 对每个 $x \in E$, $y \mapsto f(x, y)$ 是 Ω 上的连续函数,
- (iii) 存在 $0 \leq g \in L^1(E)$ 使得 $\sup_{y \in \Omega} |f(x, y)| \leq g(x)$ a.e. $x \in E$.

证明函数 $y \mapsto F(y) = \int_E f(x, y) dx$ 在 Ω 上连续.

[可用连续参量的LFC或用函数连续性的序列刻画.]

15. 设可测集列 $E_k \subset [0, 1]^d$ 和数列 $\{a_k\}_{k=1}^\infty$ 满足

$$m(E_k) \geq \delta, \quad k = 1, 2, 3, \dots; \quad \sum_{k=1}^\infty |a_k| \mathbf{1}_{E_k}(x) < \infty \quad \text{a.e. } x \in [0, 1]^d.$$

这里 $\delta > 0$ 为常数. 证明

$$\sum_{k=1}^\infty |a_k| < \infty.$$

§2.3. Riemann 积分与Lebesgue 积分的关系

在数学分析中我们已学习了Riemann 积分. 本节证明Riemann 可积的函数也是Lebesgue可积的且积分值相等. 首先回忆

【Jordan 可测集】若 $E \subset \mathbb{R}^d$ 有界且 $m(\partial E) = 0$, 则称 E 是一个Jordan 可测集. \square

典型的Jordan 可测集是有界闭区间 $I = \prod_{i=1}^d [a_i, b_i]$. 一般地, 由 $E = E^\circ \cup (E \cap \partial E)$ 易知Jordan 可测集一定是Lebesgue 可测集. 但有界的Lebesgue 可测集远非Jordan可测集: 例如设 E 是 $[0, 1]^d$ 中的有理点的全体, 则 E 是 L -可测集, 且由有理点的稠密性知 $\partial E = [0, 1]^d$ 从而有 $m(\partial E) = 1 > 0$. 因此 E 不是Jordan可测集.

【定义(Riemann 积分)】设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为一Jordan可测集.

(i) **Riemann 和.** 设 $f: E \rightarrow \mathbb{C}$ 有界. 对于 E 的任一Jordan可测分划 $P = \{E_k\}_{k=1}^n$ (即 $E = \bigcup_{k=1}^n E_k$, E_k 是Jordan 可测集且互不重叠, 即当 $i \neq j$ 时 $m(E_i \cap E_j) = 0$), 和任意标志点组 $\xi_k \in E_k, k = 1, 2, \dots, n$, 称和式

$$\sum_{k=1}^n f(\xi_k) m(E_k)$$

为 f 在 E 上的一个Riemann 和.

(ii) **Riemann 积分.** 我们称一个函数 $f: E \rightarrow \mathbb{C}$ 在 E 上Riemann 可积, 如果 f 在 E 上有界且存在常数 A 使得对任意 $\varepsilon > 0$, 存在 $\delta > 0$ 满足: 只要 E 的任意分划 $P = \{E_k\}_{k=1}^n$ 满足 $\lambda(P) := \max_{1 \leq k \leq n} \text{diam}(E_k) < \delta$, 就有

$$\sup_{\xi_k \in E_k, 1 \leq k \leq n} \left| \sum_{k=1}^n f(\xi_k) m(E_k) - A \right| < \varepsilon.$$

以上也可写成: 存在常数 A 使得

$$\sup_{\xi_k \in E_k, 1 \leq k \leq n} \left| \sum_{k=1}^n f(\xi_k) m(E_k) - A \right| \rightarrow 0 \quad \text{as} \quad \lambda(P) \rightarrow 0.$$

如果 f 在 E 上Riemann 可积, 则称Riemann和的极限 A 为 f 在 E 上的Riemann积分, 记作

$$A = (R) \int_E f(x) dx.$$

(iii) **Riemann可积函数类.** 我们把在 E 上Riemann可积的函数类记做 $\mathcal{R}(E)$. \square

几点说明:

1. Riemann积分的优点体现在Reiamm和 $\sum_{k=1}^n f(\xi_k)m(E_k)$ 上. Reiamm和的这个显示结构使得它具有直观的几何、力学、物理意义. 因此Reimann积分适合用于

建立数学模型(物理、力学、几何,...).

定积分的近似计算(各种算法格式, 包括随机算法...).

一些纯数学问题例如数论问题的研究也得益于Riemann 和的好结构.

另外注意, Riemann 和关于被积函数是线性的, 即

$$\sum_{k=1}^n (\alpha f + \beta g)(\xi_k)m(E_k) = \alpha \sum_{k=1}^n f(\xi_k)m(E_k) + \beta \sum_{k=1}^n g(\xi_k)m(E_k).$$

这些就是Riemann 积分值得保留的主要原因.

2. 对于任一有界集 $E \subset \mathbb{R}^d$, 取有界闭区间 $I = \prod_{i=1}^d [a_i, b_i]$ 充分大使得 $E \subset I$. 则在特征函数 $\mathbf{1}_E(x)$ 在 I 上Riemann可积当且仅当 E 是Jordan 可测集. 这就是为什么Riemann积分只能建立在Jordan 可测集上的本质原因. 此外为了避免非本质的纠缠, 可以直接对有界函数建立Riemann 积分.

3. 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为一Jordan可测集. 在数学分析中已证明了若 $f: E \rightarrow \mathbb{C}$ 有界, 则

$$f \in \mathcal{R}(E) \iff \lim_{\lambda(P) \rightarrow 0+} \sum_{k=1}^n \omega(f; E_k)m(E_k) = 0 \iff f \text{ 在 } E \text{ 上几乎处处连续}$$

其中 $P = \{E_k\}_{k=1}^n$ 是 E 的任一Jordan可测分划, $\omega(f; E_k)$ 是 f 在 E_k 上的振幅:

$$\omega(f; E_k) = \sup_{x, y \in E_k} |f(x) - f(y)|.$$

下面命题给出Riemann 积分与Lebesgue 积分的关系.

【命题2.3.1】 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为一Jordan可测集. 则 $\mathcal{R}(E) \subset L^1(E)$ 且当 $f \in \mathcal{R}(E)$ 时有

$$(R) \int_E f(x)dx = \int_E f(x)dx$$

上式右边为Lebesgue 积分.

【证】 设 $f \in \mathcal{R}(E)$. 由定义和上述刻画知 f 在 E 上有界且几乎处处连续. 因 E 也是Lebesgue 可测集, 故这蕴含 f 在 E 上 L -可测. 于是由 $m(E) < \infty$ (因 E 有界) 和 f 有界知 $f \in L^1(E)$. 设 $P = \{E_k\}_{k=1}^n$ 是 E 的任一Jordan可测分划. 则对任意 $\xi_k \in E_k$,

$k = 1, 2, \dots, n$, 由 L -积分的可加性有

$$\begin{aligned} & \left| \sum_{k=1}^n f(\xi_k) m(E_k) - \int_E f(x) dx \right| = \left| \sum_{k=1}^n f(\xi_k) m(E_k) - \sum_{k=1}^n \int_{E_k} f(x) dx \right| \\ &= \left| \sum_{k=1}^n \int_{E_k} [f(\xi_k) - f(x)] dx \right| \leq \sum_{k=1}^n \int_{E_k} |f(\xi_k) - f(x)| dx \leq \sum_{k=1}^n \omega(f; E_k) m(E_k). \end{aligned}$$

因此

$$\sup_{\xi_k \in E_k, 1 \leq k \leq n} \left| \sum_{k=1}^n f(\xi_k) m(E_k) - \int_E f(x) dx \right| \leq \sum_{k=1}^n \omega(f; E_k) m(E_k) \rightarrow 0 \text{ as } \lambda(P) \rightarrow 0.$$

据Riemann 积分的定义知 $(R) \int_E f(x) dx = \int_E f(x) dx$. \square

有了这一命题, 今后对例如连续函数计算Lebesgue 积分就可以考虑Riemann 和。这几乎就够了, 因为除了数值模拟外(各种算法包括随机算法), 理论计算的工具是Newton-Lebinitz 公式。本课程将在最广泛的条件下证明Newton-Lebinitz 公式。

【例】 (计算Gauss积分) 证明

$$\int_{\mathbb{R}} e^{-x^2} dx = \sqrt{\pi}.$$

【证】 由Lebesgue 积分的扩张定理知

$$\int_{\mathbb{R}} e^{-x^2} dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{-n}^n e^{-x^2} dx.$$

因被积函数 e^{-x^2} 连续, 故右边的积分也是Riemann 积分, 即

$$\int_{-n}^n e^{-x^2} dx = (R) \int_{-n}^n e^{-x^2} dx, \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

于是由数学分析中对广义Riemann 积分的定义和计算结果知

$$\int_{\mathbb{R}} e^{-x^2} dx = \lim_{n \rightarrow \infty} (R) \int_{-n}^n e^{-x^2} dx = (R) \int_{-\infty}^{\infty} e^{-x^2} dx = \sqrt{\pi}.$$

我们在学完关于Lebesgue积分的Fubini定理和重积分换元公式后, 还会再次证明这个Gauss 积分等式。 \square

作业题: 设开集 $\Omega \supset [0, 1]^d \cap \mathbb{Q}^d$ 且 $m(\Omega) < 1$. 令 $K = [0, 1]^d \setminus \Omega$, $g(x) = \mathbf{1}_K(x)$. 证明 (1) $g \notin \mathcal{R}([0, 1]^d)$. (2) 对任意 $f \in \mathcal{R}([0, 1]^d)$ 有 $\int_{[0, 1]^d} |f(x) - g(x)| dx > 0$. (3) Riemann 和的序列

$$S_n := \frac{1}{n^d} \sum_{k_1=1}^n \sum_{k_2=1}^n \cdots \sum_{k_d=1}^n g\left(\frac{k_1}{n}, \frac{k_2}{n}, \dots, \frac{k_d}{n}\right) \not\rightarrow \int_{[0, 1]^d} g(x) dx \quad (n \rightarrow \infty).$$

§2.4. 简单的积分换元公式和Newton-Leibnitz 公式

对于积分的计算和估计, 基本工具是Newton-Leibnitz 公式(与分部积分), 积分号下求导, 和重积分化累次积分(Fubini定理)。这些基本工具我们在数学分析中也学习过, 本课程(实分析) 的一大贡献是: 使这些工具在更大范围、更弱条件下仍然成立。

本节学习简单的换元公式, Newton-Leibnitz公式, 和积分号下求导定理。这里简单换元公式是指在平移、展缩和一般线性变换下的积分换元公式。一般的换元公式将本章最后一节学习。

【定理2.4.1(平移和线性变换下的积分换元公式)】 设 f 在 \mathbb{R}^d 上 L -可积或非负可测。则对任意 $h \in \mathbb{R}^d, \lambda \in \mathbb{R} \setminus \{0\}$ 有

$$\int_{\mathbb{R}^d} f(x+h)dx = \int_{\mathbb{R}^d} f(x)dx \quad (\text{全空间积分的平移不变性}),$$

$$\int_{\mathbb{R}^d} f(\lambda x+h)dx = \int_{\mathbb{R}^d} f(\lambda x)dx = \frac{1}{|\lambda|^d} \int_{\mathbb{R}^d} f(x)dx \quad (\text{积分的平移和展缩关系}),$$

一般地, 对任意可逆矩阵 $A \in \mathbb{R}^{d \times d}$ 有

$$\int_{\mathbb{R}^d} f(Ax+h)dx = \int_{\mathbb{R}^d} f(Ax)dx = \frac{1}{|\det A|} \int_{\mathbb{R}^d} f(x)dx.$$

【证】 只需就 f 非负的情形证明即可. 事实上若对非负的情形定理成立, 则对于实值可积函数 f , 分别对 f 的正部 f^+ 和负部 f^- 应用定理并结合 $f = f^+ - f^-$ 以及 f^+ 和 f^- 的积分皆有限从而可以做减法即知 f 具有定理中的性质. 而对复值可积函数 f , 分别对 f 的实部 $\operatorname{Re}(f)$ 和虚部 $\operatorname{Im}(f)$ 应用实值可积函数的结果并根据复值函数积分的定义即知 f 仍具有定理中的性质.

因平移不变性和展缩关系是 $A = I$ (单位矩阵) 和 $A = \lambda I$ 的特殊情形, 故只需证明一般情形.

先设 $f(x) = \mathbf{1}_E(x)$ 是可测集 $E \subset \mathbb{R}^d$ 的特征函数. 则有

$$\mathbf{1}_E(Ax+h) = \mathbf{1}_{A^{-1}(E-h)}(x).$$

由测度的平移不变性和线性变换下的测度公式有

$$\begin{aligned} \int_{\mathbb{R}^d} \mathbf{1}_E(Ax+h)dx &= \int_{\mathbb{R}^d} \mathbf{1}_{A^{-1}(E-h)}(x)dx = m(A^{-1}(E-h)) = |\det A^{-1}|m(E-h) \\ &= \frac{1}{|\det A|}m(E) = \frac{1}{|\det A|} \int_{\mathbb{R}^d} \mathbf{1}_E(x)dx \end{aligned}$$

其次设 f 在 \mathbb{R}^d 上的非负可测. 由非负可测函数的级数表示, 存在 \mathbb{R}^d 上的一列可测集 E_k 和常数 $c_k > 0$ 使得

$$f(x) = \sum_{k=1}^{\infty} c_k 1_{E_k}(x), \quad x \in \mathbb{R}^d.$$

易见

$$f(Ax + h) = \sum_{k=1}^{\infty} c_k 1_{E_k}(Ax + h), \quad x \in \mathbb{R}^d.$$

于是由非负可测函数级数的逐项积分和上面结果即得

$$\begin{aligned} \int_{\mathbb{R}^d} f(Ax + h) dx &= \sum_{k=1}^{\infty} c_k \int_{\mathbb{R}^d} 1_{E_k}(Ax + h) dx = \frac{1}{|\det A|} \sum_{k=1}^{\infty} c_k \int_{\mathbb{R}^d} 1_{E_k}(x) dx \\ &= \frac{1}{|\det A|} \int_{\mathbb{R}^d} \sum_{k=1}^{\infty} c_k 1_{E_k}(x) dx = \frac{1}{|\det A|} \int_{\mathbb{R}^d} f(x) dx. \quad \square \end{aligned}$$

【定理2.4.2(平移和线性变换下的积分换元公式)的推论】

(a) 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为可测集, $h \in \mathbb{R}^d$, f 在 $E + h$ 上 L -可积或非负可测. 则有

$$\int_E f(x + h) dx = \int_{E+h} f(x) dx.$$

(b) 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为可测集, $A \in \mathbb{R}^{d \times d}$ 可逆, f 在 $A(E)$ 上可积或非负可测. 则有

$$\int_E f(Ax) dx = \frac{1}{|\det A|} \int_{A(E)} f(x) dx.$$

【证】为应用上述定理, 我们将 f 零延拓到 \mathbb{R}^d 上, 即分别考虑 $1_{E+h}(x)f(x)$ 和 $1_{A(E)}(x)f(x)$, $x \in \mathbb{R}^d$.

(a): 由 $1_E(x) = 1_{E+h}(x + h)$ 和全空间积分的平移不变性有

$$\begin{aligned} \int_E f(x + h) dx &= \int_{\mathbb{R}^d} 1_E(x) f(x + h) dx = \int_{\mathbb{R}^d} 1_{E+h}(x + h) f(x + h) dx \\ &= \int_{\mathbb{R}^d} 1_{E+h}(x) f(x) dx = \int_{E+h} f(x) dx. \end{aligned}$$

(b): 类似地, 由 A 可逆有 $1_E(x) = 1_{A(E)}(Ax)$. 应用全空间积分的线性变换公式即得

$$\begin{aligned} \int_E f(Ax) dx &= \int_{\mathbb{R}^d} 1_E(x) f(Ax) dx = \int_{\mathbb{R}^d} 1_{A(E)}(Ax) f(Ax) dx \\ &= \frac{1}{|\det A|} \int_{\mathbb{R}^d} 1_{A(E)}(x) f(x) dx = \frac{1}{|\det A|} \int_{A(E)} f(x) dx. \quad \square \end{aligned}$$

【例($d = 1$)】(1) 设 $f \in L^1((a, \infty))$ 或 f 在 (a, ∞) 上非负可测. 则对任意 $b \in (a, \infty)$ 和 $h > 0$ 有

$$\int_a^b f(x+h)dx = \int_{a+h}^{b+h} f(x)dx.$$

(2) 设函数 f 在 $(0, \infty)$ 上 L -可测. 对于常数 $a > 0$, 作线性换元 $x = \frac{t}{a}, t \in (0, \infty)$, 则有 $dx = \frac{1}{a}dt$, 并在换元后的积分中将字母 t 再换成 x , 可得以下结果:

(a) 若 $\frac{f(x)}{x} \in L^1((0, \infty))$, 则有

$$\int_0^\infty \frac{f(ax)}{x} dx = \int_0^\infty \frac{f(x)}{x} dx \quad \forall a > 0.$$

(b) 若 $\frac{f(x)}{x} \in L^1((\varepsilon, +\infty))$ for all $\varepsilon > 0$. 则有

$$\int_\varepsilon^\infty \frac{f(ax)}{x} dx = \int_{a\varepsilon}^\infty \frac{f(x)}{x} dx \quad \forall a > 0, \forall \varepsilon > 0.$$

□

【例】设 $2 \leq p \in \mathbb{N}$ 并设 E_n^j 是区间 $[0, 1]$ 中的这样的实数 x 的全体: x 的 p -进制表示中的第 n 位数字为 j ($j \in \{0, 1, \dots, p\}$). 证明 E_n^i 是可测集且

$$m(E_n^0) = m(E_n^1) = \dots = m(E_n^{p-1}) = \frac{1}{p}, \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

并且对任意 $i \in \{0, 1, \dots, p-1\}$ 和任意 $f \in L^1([0, 1])$ 有

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_{E_n^i} f(x) dx = \frac{1}{p} \int_0^1 f(x) dx.$$

[本题说明, 从几何和概率上看, $E_n^0, E_n^1, \dots, E_n^{p-1}$ 的地位是一样的.]

【证】令 $E_{\text{ir}} = E \setminus \mathbb{Q}$ 为 E 中无理数的全体. 则易见对任意 $j \in \{0, 1, \dots, p-1\}$ 有

$$(E_1^j)_{\text{ir}} = \left[\frac{j}{p}, \frac{j+1}{p} \right)_{\text{ir}},$$

$$(E_n^j)_{\text{ir}} = \bigcup_{a_1, a_2, \dots, a_{n-1} \in \{0, 1, \dots, p-1\}} \left[\sum_{k=1}^{n-1} \frac{a_k}{p^k} + \frac{j}{p^n}, \sum_{k=1}^{n-1} \frac{a_k}{p^k} + \frac{j+1}{p^n} \right)_{\text{ir}}, \quad n \geq 2.$$

因 \mathbb{Q} 是 L -零测集, 故这表明 E_n^j 是 L -可测集且由可加性有 (因上式右边是不交并)

$$m(E_n^j) = m((E_n^j)_{\text{ir}}) = p^{n-1} \frac{1}{p^n} = \frac{1}{p}.$$

此外易见对任意 $n \in \mathbb{N}$ 有

$$[0, 1]_{\text{ir}} = \bigcup_{j=0}^{p-1} (E_n^j)_{\text{ir}}, \quad (E_n^j)_{\text{ir}} = (E_n^0)_{\text{ir}} + \frac{j}{p^n}, \quad j = 1, 2, \dots, p-1.$$

将 f 零延拓到 \mathbb{R} 上, 则 $f \in L^1(\mathbb{R})$ 且有 (因 $E_n^j \cap \mathbb{Q}$ 是零测集)

$$\begin{aligned}\int_0^1 f(x)dx &= \int_{[0,1]_{\text{ir}}} f(x)dx = \sum_{j=0}^{p-1} \int_{(E_n^j)_{\text{ir}}} f(x)dx = \sum_{j=0}^{p-1} \int_{E_n^j} f(x)dx, \\ \int_{E_n^j} f(x)dx &= \int_{E_n^0 + \frac{j}{p^n}} f(x)dx = \int_{E_n^0} f(x + \frac{j}{p^n})dx = \int_{E_n^0} f(x)dx + \Delta_{n,j}\end{aligned}$$

其中

$$\Delta_{n,j} = \int_{E_n^0} [f(x + \frac{j}{p^n}) - f(x)]dx.$$

据可积函数的平均连续性有

$$|\Delta_{n,j}| \leq \int_{\mathbb{R}} |f(x + \frac{j}{p^n}) - f(x)|dx \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty), \quad j = 0, 1, \dots, p-1.$$

由此有

$$\begin{aligned}\int_0^1 f(x)dx &= p \int_{E_n^0} f(x)dx + \sum_{j=0}^{p-1} \Delta_{n,j}, \\ \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{E_n^0} f(x)dx &= \frac{1}{p} \int_0^1 f(x)dx + \frac{1}{p} \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{j=0}^{p-1} \Delta_{n,j} = \frac{1}{p} \int_0^1 f(x)dx, \\ \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{E_n^j} f(x)dx &= \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{E_n^0} f(x)dx + \lim_{n \rightarrow \infty} \Delta_{n,j} = \frac{1}{p} \int_0^1 f(x)dx, \quad j = 0, 1, \dots, p-1.\end{aligned}$$

□

【命题2.4.3(积分中值定理)】 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为一连通的可测集, $0 < m(E) < \infty$, 实值函数 $f \in L^1(E)$. 则存在 $\xi \in E$ 使得

$$f(\xi) = \frac{1}{m(E)} \int_E f(x)dx.$$

【证】 令 $a = \inf_{x \in E} f(x)$, $b = \sup_{x \in E} f(x)$. 则 $-\infty \leq a, b \leq +\infty$ (Γ^+ 实数) 且由 $f \in L^1(E)$ 和简单的积分不等式有

$$a \leq \frac{1}{m(E)} \int_E f(x)dx \leq b.$$

若这两个不等式中有一个是等式, 例如设

$$a = \frac{1}{m(E)} \int_E f(x)dx.$$

则 $a \in \mathbb{R}$ (即 $-\infty < a < +\infty$) 并由非负性 $f(x) - a \geq 0$ for all $x \in E$ 和

$$\int_E (f(x) - a)dx = \int_E f(x)dx - am(E) = 0$$

可知 $f(x) - a = 0$ a.e. $x \in E$, 即 $E(f \neq a)$ 是零测集. 因 $m(E) > 0$ 故 $E(f = a) = E \setminus E(f \neq a)$ 非空. 取 $\xi \in E(f = a)$ 即知

$$f(\xi) = a = \frac{1}{m(E)} \int_E f(x) dx.$$

现在设

$$a < \frac{1}{m(E)} \int_E f(x) dx < b.$$

则由确界的定义(包括 $a = -\infty$ 或 $b = +\infty$ 的情形), 存在 $x_0, y_0 \in E$ 使得

$$f(x_0) < \frac{1}{m(E)} \int_E f(x) dx < f(y_0).$$

因 E 连通, 故由连通集上的连续函数介值定理即知存在 $\xi \in E$ 使得

$$f(\xi) = \frac{1}{m(E)} \int_E f(x) dx. \quad \square$$

• Newton-Leibniz公式

Newton-Leibniz公式也称为微积分基本定理, 它既是理论和计算工具, 也给出了微分与积分的关系。以下两个定理和证明参照W. Rudin的教科书*Real and Complex Analysis*. 为尽量放宽Newton-Leibniz公式成立的条件, 我们需要证明可积函数的如下性质:

【Vitali-Caratheódory 定理】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f \in L^1(E)$. 则对任意 $\varepsilon > 0$, 存在 \mathbb{R}^d 上的广义实值函数 u, v 满足

1° $u, v \in L^1(E)$, $u(x) \leq f(x) \leq v(x)$ for all $x \in E$ 且

$$\int_E (v(x) - u(x)) dx < \varepsilon.$$

2° 对任意 $t \in \mathbb{R}$, 集合 $\{x \in \mathbb{R}^d \mid u(x) < t\}$ 和 $\{x \in \mathbb{R}^d \mid v(x) > t\}$ 都是开集. (具有这样性质的函数 u, v 分别称为上半连续和下半连续函数.)

【证】 由 $f \in L^1(E)$ 知 f 在 E 上几乎处处有限. 因去掉一个零测集对可积性和积分无影响, 故我们可以假定 f 在 E 上处处有限。

首先假定 $f \geq 0$ 于 E . 根据简单函数逼近定理, 存在一系列常数 $0 < c_k < \infty$ 和可测集 $E_k \subset E$ 使得

$$f(x) = \sum_{k=1}^{\infty} c_k \mathbf{1}_{E_k}(x) \quad \forall x \in E.$$

由非负可测函数的逐项积分有

$$\int_E f(x)dx = \sum_{k=1}^{\infty} c_k m(E_k).$$

因 f 在 E 上可积, 上面级数是收敛的. 因此对任意 $\varepsilon > 0$, 存在 $N \in \mathbb{N}$ 使得

$$\sum_{k=N+1}^{\infty} c_k m(E_k) < \varepsilon/2.$$

由Lebesgue可测集的正则性, 对每个 E_k , 存在紧集 K_k 和开集 U_k 使得 $K_k \subset E_k \subset U_k$,

$$c_k m(U_k \setminus K_k) < 2^{-k-1} \varepsilon, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

令

$$v(x) = \sum_{k=1}^{\infty} c_k \mathbf{1}_{U_k}(x), \quad u(x) = \sum_{k=1}^N c_k \mathbf{1}_{K_k}(x), \quad x \in \mathbb{R}^d.$$

则 $u(x) \leq f(x) \leq v(x)$ for all $x \in E$ 且 (由 $\mathbf{1}_{U_k} = \mathbf{1}_{E_k} + \mathbf{1}_{U_k \setminus E_k} \leq \mathbf{1}_{E_k} + \mathbf{1}_{U_k \setminus K_k}$)

$$\begin{aligned} v(x) - u(x) &= \sum_{k=1}^N c_k (\mathbf{1}_{U_k}(x) - \mathbf{1}_{K_k}(x)) + \sum_{k=N+1}^{\infty} c_k \mathbf{1}_{U_k}(x) \\ &= \sum_{k=1}^N c_k \mathbf{1}_{U_k \setminus K_k}(x) + \sum_{k=N+1}^{\infty} c_k \mathbf{1}_{U_k}(x) \leq \sum_{k=1}^N c_k \mathbf{1}_{U_k \setminus K_k}(x) + \sum_{k=N+1}^{\infty} c_k \mathbf{1}_{E_k}(x) \end{aligned}$$

\Rightarrow

$$\int_E (v(x) - u(x))dx \leq \sum_{k=1}^N c_k m(U_k \setminus K_k) + \sum_{k=N+1}^{\infty} c_k m(E_k) < \varepsilon/2 + \varepsilon/2 = \varepsilon.$$

下证 u, v 的半连续性. 任给 $t \in \mathbb{R}$. 由级数的定义和 u 为有限和易见

$$\{x \in \mathbb{R}^d \mid v(x) > t\} = \bigcup_{n=1}^{\infty} \{x \in \mathbb{R}^d \mid \sum_{k=1}^n c_k \mathbf{1}_{U_k}(x) > t\},$$

$$\{x \in \mathbb{R}^d \mid u(x) < t\} = \{x \in \mathbb{R}^d \mid \sum_{k=1}^N c_k \mathbf{1}_{(K_k)^c}(x) > \sum_{k=1}^N c_k - t\}.$$

因此为证明上式左边为开集, 只需证明若 $n \in \mathbb{N}$, $\Omega_k \subset \mathbb{R}^d$ 是开集, $k = 1, 2, \dots, n$, 则对任意 $t \in \mathbb{R}$,

$$G_t := \{x \in \mathbb{R}^d \mid \sum_{k=1}^n c_k \mathbf{1}_{\Omega_k}(x) > t\}.$$

是开集. 当 $t < 0$ 时, $G_t = \mathbb{R}^d$ 是开集. 设 $t \geq 0$. 对任意 $x_0 \in G_t \Rightarrow \sum_{k=1}^n c_k \mathbf{1}_{\Omega_k}(x_0) > t$. 因一切 $c_k > 0$ 故存在 $1 \leq k_1 < k_2 < \dots < k_p \leq n$ 使得 $\mathbf{1}_{\Omega_k}(x_0) = 1 \quad \forall k \in \{k_1, k_2, \dots, k_p\}$; $\mathbf{1}_{\Omega_k}(x_0) = 0 \quad \forall k \in \{1, 2, \dots, n\} \setminus \{k_1, k_2, \dots, k_p\}$. 因此

$$x_0 \in \bigcap_{j=1}^p \Omega_{k_j}, \quad \sum_{j=1}^p c_{k_j} = \sum_{j=1}^p c_{k_j} \mathbf{1}_{\Omega_{k_j}}(x_0) = \sum_{k=1}^n c_k \mathbf{1}_{\Omega_k}(x_0) > t.$$

因有限个开集的交是开集, 故存在 $\delta > 0$ 使得 $B(x_0, \delta) \subset \bigcap_{j=1}^p \Omega_{k_j}$ 从而有

$$\sum_{k=1}^d c_k \mathbf{1}_{\Omega_k}(x) \geq \sum_{j=1}^p c_{k_j} \mathbf{1}_{\Omega_{k_j}}(x) = \sum_{j=1}^p c_{k_j} > t \quad \forall x \in B(x_0, \delta)$$

所以 $B(x_0, \delta) \subset G_t$. 所以 G_t 是开集.

转到一般情形. 对于 $f = f^+ - f^-$ 的正部 f^+ 和负部 f^- , 如上分别作出上半连续函数 u_1, u_2 和下半连续函数 v_1, v_2 , 使得 $u_1 \leq f^+ \leq v_1$, $u_2 \leq f^- \leq v_2$ 于 E 且 u_1, u_2 在 \mathbb{R}^d 上处处有限. 令 $u = u_1 - v_2$, $v = v_1 - u_2$. 则 $u \leq f \leq v$. 这蕴涵

$$|u| \leq v - u + |f|, \quad |v| \leq v - u + |f| \quad \text{on } E.$$

因此 $u, v \in L^1(E)$. 还需证明 u 上半连续, v 下半连续.

一般地我们证明若 φ 上半连续, ψ 下半连续, 且两者之一处处有限, 则 $\varphi - \psi$ 上半连续, $\psi - \varphi$ 下半连续. 事实上对任意 $t \in \mathbb{R}$, 由有理数 $\mathbb{Q} = \{r_1, r_2, r_3, \dots\}$ 的稠密性, 我们有分解

$$\{x \in \mathbb{R}^d \mid \varphi(x) - \psi(x) < t\} = \bigcup_{k=1}^{\infty} \{x \in \mathbb{R}^d \mid \varphi(x) < r_k\} \cap \{x \in \mathbb{R}^d \mid \psi(x) > r_k - t\}.$$

因任意多个开集的并是开集, 所以 $\{x \in \mathbb{R}^d \mid \varphi(x) - \psi(x) < t\}$ 是开集. 由此对任意 $t \in \mathbb{R}$ 有 $\{x \in \mathbb{R}^d \mid \psi(x) - \varphi(x) > t\} = \{x \in \mathbb{R}^d \mid \varphi(x) - \psi(x) < -t\}$ 是开集. [注: 由 φ, ψ 之一处处有限可知 $\varphi(x) - \psi(x)$ 处处有意义.] \square

【定理(Newton-Leibniz公式)】 设实值或复值函数 $f(x)$ 在有界闭区间 $[a, b]$ 上连续、在开区间 (a, b) 内处处可导且导函数 $f'(x)$ 在 (a, b) 上 L -可积, 则有

$$\int_a^b f'(x) dx = f(b) - f(a). \quad (2.4.1)$$

【证】 先说明若这定理对实值函数成立, 则它对复值函数也成立. 这是因为由假设知 $f = f_1 + i f_2$ 的实部、虚部 f_1, f_2 都分别满足定理条件从而有

$$\int_a^b f'(x) dx = \int_a^b f_1'(x) dx + i \int_a^b f_2'(x) dx = f_1(b) - f_1(a) + i(f_2(b) - f_2(a)) = f(b) - f(a).$$

这表明为证明这一定理, 可以假设 f 是实值的. 证明分两步.

Step1. 考虑稍强的假设: 设 $f(x)$ 在闭区间 $[a, b]$ 上处处可导且导函数 $f'(x)$ 在 $[a, b]$ 上 L -可积.

给定任意 $\varepsilon > 0$. 由Vitali-Caratheódory 定理, 存在下半连续函数 $g: \mathbb{R} \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 使得 $g \in L^1([a, b])$, $f'(x) \leq g(x)$ 于 $[a, b]$ 且

$$\int_a^b g(x)dx < \int_a^b f'(x)dx + \varepsilon. \quad (2.4.2)$$

如用 $\tilde{g}(x) = g(x) + \varepsilon_1/(b-a)$ 代替 $g(x)$, 其中常数 $\varepsilon_1 > 0$ 充分小使不等式(2.4.2) 对 \tilde{g} 也成立, 则我们可假定 g 满足严格不等式³:

$$f'(x) < g(x) \quad \forall x \in [a, b].$$

对任一 $\eta > 0$, 定义

$$F_\eta(x) = \int_a^x g(t)dt - f(x) + f(a) + \eta(x-a), \quad x \in [a, b]. \quad (2.4.3)$$

来证明 $F_\eta(b) \geq 0$. 固定 η , 对每个 $x \in [a, b)$, 因 g 下半连续且 $g(x) > f'(x)$, 故 $\{t \in \mathbb{R} \mid g(t) > f'(x)\}$ 是开集且包含 x . 因此存在 $\delta_x > 0$ 使得

$$(x, x + \delta_x) \subset [a, b) \quad \text{且} \quad g(t) > f'(x), \quad \frac{f(t) - f(x)}{t - x} < f'(x) + \eta \quad \forall t \in (x, x + \delta_x).$$

于是对任何 $t \in (x, x + \delta_x)$ 有

$$\begin{aligned} F_\eta(t) - F_\eta(x) &= \int_x^t g(\tau)d\tau - [f(t) - f(x)] + \eta(t - x) \\ &> f'(x)(t - x) - [f'(x) + \eta](t - x) + \eta(t - x) = 0. \end{aligned}$$

因 F_η 在 $[a, b]$ 上连续且 $F_\eta(a) = 0$, 故存在一个满足 $F_\eta(x) = 0$ 的最大点 $x_0 \in [a, b]$. 若 $x_0 = b$, 则有 $F_\eta(b) = 0$; 若 $x_0 < b$, 则上面的计算蕴涵 $F_\eta(t) > F_\eta(x_0) = 0 \quad \forall t \in (x_0, x_0 + \delta_{x_0})$, 从而由介值定理和 x_0 的最大性知必有 $F_\eta(b) \geq 0$. 所以在任何情况下都有 $F_\eta(b) \geq 0$.

因为 $F_\eta(b) \geq 0$ 对所有 $\eta > 0$ 成立, 故由 $F_\eta(b)$ 的表达式(2.4.3)($x = b$) 得到

$$f(b) - f(a) \leq \int_a^b g(t)dx + \eta(b-a) \quad \forall \eta > 0.$$

令 $\eta \rightarrow 0$ 并结合(2.4.2)得到

$$f(b) - f(a) \leq \int_a^b g(t)dt < \int_a^b f'(t)dt + \varepsilon.$$

因 $\varepsilon > 0$ 是任意的, 这就给出

$$f(b) - f(a) \leq \int_a^b f'(x)dx. \quad (2.4.4)$$

³由假设和导数的定义知 $f'(x)$ 在 $[a, b]$ 上处处有限, 因此不会出现 “ $\infty < \infty$ ” 的情形.

最后注意 $-f$ 也满足定理中的假设,且 $(-f)' = -f'$,故不等式(2.4.4)的反向不等式也成立.这就证明了等式(2.4.1).

Step2. 回到定理中的假设. 令 $a_n = a + \frac{b-a}{4n}$, $b_n = b - \frac{b-a}{4n}$, $n = 1, 2, 3, \dots$. 则 f 在每个 $[a_n, b_n]$ 上满足**Step1**中的条件. 于是由积分的扩张定理、(2.4.1)和 f 的连续性得到

$$\int_a^b f'(x)dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{a_n}^{b_n} f'(x)dx = \lim_{n \rightarrow \infty} [f(b_n) - f(a_n)] = f(b) - f(a). \quad \square$$

【注】 由于Lebesgue可积的函数不必是有界的,上述Newton-Leibniz公式包括了导函数 $f'(x)$ 无界的情形.下同.

【命题2.4.4(无界区间上的Newton-Leibniz公式)】

(a) 设 $f(x)$ 在 $[a, +\infty)$ 上连续、在开区间 $(a, +\infty)$ 内处处可导且导函数 $f'(x)$ 在 $(a, +\infty)$ 上可积,则极限 $f(+\infty) := \lim_{x \rightarrow +\infty} f(x)$ 存在有限且成立

$$\int_a^{\infty} f'(x)dx = f(+\infty) - f(a).$$

(b) 设 $f(x)$ 在 $(-\infty, a]$ 上连续、在开区间 $(-\infty, a)$ 内处处可导且导函数 $f'(x)$ 在 $(-\infty, a)$ 上可积,则极限 $f(-\infty) := \lim_{x \rightarrow -\infty} f(x)$ 存在有限且成立

$$\int_{-\infty}^a f'(x)dx = f(a) - f(-\infty).$$

(c) 设 $f(x)$ 在 \mathbb{R} 上处处可导且导函数 $f'(x)$ 在 \mathbb{R} 上可积.则极限 $f(+\infty) := \lim_{x \rightarrow +\infty} f(x)$, $f(-\infty) := \lim_{x \rightarrow -\infty} f(x)$ 都存在有限且成立

$$\int_{\mathbb{R}} f'(x)dx = \int_{-\infty}^{\infty} f'(x)dx = f(+\infty) - f(-\infty).$$

【证】 (a): 在 $(a, +\infty)$ 内任取点单调增加趋于 $+\infty$ 的点列: $x_n \nearrow +\infty$. 应用有界区间上的Newton-Leibniz公式和可积性的扩张定理有

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} f(x_n) = f(a) + \lim_{n \rightarrow +\infty} \int_a^{x_n} f'(x)dx = f(a) + \int_a^{\infty} f'(x)dx.$$

由 $\{x_n\}$ 的任意性,这证明了 $f(+\infty) := \lim_{x \rightarrow +\infty} f(x)$ 存在且所证公式成立.

(b): 证明与(a)的相同.

(c): 将(a),(b) 分别应用于 $[0, +\infty)$, $(-\infty, 0]$ 知极限 $f(+\infty) = \lim_{x \rightarrow +\infty} f(x)$, $f(-\infty) := \lim_{x \rightarrow -\infty} f(x)$ 均存在有限从而有

$$\begin{aligned}\int_{-\infty}^{\infty} f'(x)dx &= \int_{-\infty}^0 f'(x)dx + \int_0^{\infty} f'(x)dx \\ &= f(0) - f(-\infty) + f(+\infty) - f(0) = f(+\infty) - f(-\infty). \quad \square\end{aligned}$$

【命题2.4.5(分部积分)】

(a) 设 f, g 在有界闭区间 $[a, b]$ 上连续在 (a, b) 内处处可导, 且 $f'(x)$ 和 $g'(x)$ 都在 (a, b) 上可积. 则

$$\int_a^b f'(x)g(x)dx = f(x)g(x)\Big|_{x=a}^{x=b} - \int_a^b f(x)g'(x)dx.$$

(b) 设 f, g 在区间 $[a, +\infty)$ 上连续在 $(a, +\infty)$ 内处处可导且 $f'(x), g'(x)$ 都在 $(a, +\infty)$ 上可积. 则

$$\int_a^{\infty} f'(x)g(x)dx = f(x)g(x)\Big|_{x=a}^{x=+\infty} - \int_a^{\infty} f(x)g'(x)dx.$$

(c) 设 f, g 在区间 $(-\infty, a]$ 上连续在 $(-\infty, a)$ 内处处可导, 且 $f'(x), g'(x)$ 都在 $(-\infty, a)$ 上可积. 则

$$\int_{-\infty}^a f'(x)g(x)dx = f(x)g(x)\Big|_{x=-\infty}^{x=a} - \int_{-\infty}^a f(x)g'(x)dx.$$

(d) 设 f, g 在 \mathbb{R} 处处可导且 $f'(x), g'(x)$ 都在 \mathbb{R} 上可积. 则

$$\int_{\mathbb{R}} f'(x)g(x)dx = f(x)g(x)\Big|_{x=-\infty}^{x=+\infty} - \int_{\mathbb{R}} f(x)g'(x)dx.$$

注: 这个结论当 $[a, b]$ 换为无界闭区间时也成立(参见下面证明).

【证】(a): 因紧集上的连续函数必有界, 故 $f'(x)g(x), f(x)g'(x)$ 从而 $(fg)'(x) = f'(x)g(x) + f(x)g'(x)$ 都在 (a, b) 上可积。于是对 fg 应用Newton-Leibniz公式便有

$$f(x)g(x)\Big|_{x=a}^{x=b} = \int_a^b (fg)'(x)dx = \int_a^b f'(x)g(x)dx + \int_a^b f(x)g'(x)dx.$$

移项即得分部积分公式.

(b): 由假设和命题2.4.4(无界区间上的Newton-Leibniz公式) 知 f, g 都在 $[a, +\infty)$ 上有界, 因此 $f'(x)g(x), f(x)g'(x)$ 从而 $(fg)'(x) = f'(x)g(x) + f(x)g'(x)$ 都在 $(a, +\infty)$ 上可积。于是对 fg 应用无界区间上的Newton-Leibniz公式便有

$$f(x)g(x)\Big|_{x=a}^{x=+\infty} = \int_a^{\infty} (fg)'(x)dx = \int_a^{\infty} f'(x)g(x)dx + \int_a^{\infty} f(x)g'(x)dx.$$

移项即得分部积分公式.

(c): 证法同上.

(d): 由假设和**命题2.4.4(无界区间上的Newton-Leibniz公式)**知 f, g 都在 \mathbb{R} 上有界, 因此 $f'(x)g(x), f(x)g'(x)$ 从而 $(fg)'(x) = f'(x)g(x) + f(x)g'(x)$ 都在 \mathbb{R} 上可积. 于是对 fg 应用无界区间上的Newton-Leibniz公式便有

$$f(x)g(x)\Big|_{x=-\infty}^{x=+\infty} = \int_{\mathbb{R}} (fg)'(x)dx = \int_{\mathbb{R}} f'(x)g(x)dx + \int_{\mathbb{R}} f(x)g'(x)dx.$$

移项即得分部积分公式. \square

单调函数的Newton-Leibniz公式.

单调函数类在分析学、概率论及其应用占有重要地位. 相应的Newton-Leibniz公式的条件也可简化. 不失一般性我们只考虑单调增加的情形. 证明基于两点: (1)单调函数总有极限, (2)单调增加的可微函数的导函数是非负可测函数, 因而其积分总存在(可能为无穷大).

【命题2.4.6(单调函数的Newton-Leibniz公式)】 设 $-\infty \leq a < b \leq +\infty$, 函数 $f(x)$ 在 (a, b) 内处处可微且单调增加(不必有界), 则有

$$\int_a^b f'(x)dx = \lim_{x \rightarrow b-} f(x) - \lim_{x \rightarrow a+} f(x) =: f(b-) - f(a+).$$

因此特别有:

当 $-\infty < a < b < \infty$ 且 $f(x)$ 在 a 点右连续、在 b 点左连续时

$$\int_a^b f'(x)dx = f(b) - f(a);$$

当 $-\infty < a < b = +\infty$ 且 $f(x)$ 在 a 点右连续时

$$\int_a^{\infty} f'(x)dx = f(+\infty) - f(a);$$

当 $-\infty = a < b < \infty$ 且 $f(x)$ 在 b 点左连续时

$$\int_{-\infty}^b f'(x)dx = f(b) - f(-\infty);$$

当 $-\infty = a < b = +\infty$ 时

$$\int_{-\infty}^{\infty} f'(x)dx = f(+\infty) - f(-\infty).$$

【证】先假设 $[a, b]$ 是有界闭区间、 f 在 $[a, b]$ 上连续、单调增加且在 (a, b) 内处处可导。为证 f 满足Newton-Leibniz公式, 根据命题7.1, 只需证明 $f'(x)$ 在 (a, b) 上可积。

将 f 延拓至 $[a, +\infty): f(x) = f(b), x \geq b$; 并令 $f_n(x) = n[f(x+1/n) - f(x)], x \in [a, b]$ 。由 f 单调增加有 $f_n(x) \geq 0$ 且

$$f'(x) = \lim_{n \rightarrow +\infty} f_n(x) \quad \forall x \in (a, b).$$

应用Fatou引理得

$$\int_a^b f'(x)dx \leq \liminf_{n \rightarrow +\infty} \int_a^b f_n(x)dx.$$

另一方面, 利用积分的平移变换公式和可加性我们计算

$$\begin{aligned} \int_a^b (f(x+1/n) - f(x))dx &= \int_a^b f(x+1/n)dx - \int_a^b f(x)dx \\ &= \int_{a+1/n}^{b+1/n} f(x)dx - \int_a^b f(x)dx = \int_b^{b+1/n} f(x)dx - \int_a^{a+1/n} f(x)dx \\ &= \frac{1}{n}[f(\alpha_n) - f(\beta_n)] \end{aligned}$$

其中 $\alpha_n \in (a, a+1/n), \beta_n \in (b, b+1/n)$ (这里用到连续函数的积分中值定理)。于是

$$\int_a^b f_n(x)dx = f(\beta_n) - f(\alpha_n) \rightarrow f(b) - f(a) \quad (n \rightarrow +\infty).$$

这就给出

$$\int_a^b f'(x)dx \leq f(b) - f(a) < \infty.$$

因 $f'(x) \geq 0 \quad \forall x \in (a, b)$, 所以 $f'(x)$ 在 (a, b) 上可积。于是Newton-Leibniz公式成立, 即等号成立: $\int_a^b f'(x)dx = f(b) - f(a)$ 。

对一般情形, 选取 a_n, b_n 满足 $a < a_n < b_n < b$ 且 $a_n \searrow a, b_n \nearrow b (n \rightarrow +\infty)$ 。由假设和上面结果易见 f 在每个区间 $[a_n, b_n]$ 上满足Newton-Leibniz公式。因 $[a_n, b_n] \subset [a_{n+1}, b_{n+1}] \subset (a, b), \bigcup_{n=1}^{\infty} [a_n, b_n] = (a, b)$, 且 $f(x)$ 单调增加、 $f'(x) \geq 0$ 于 (a, b) , 应用非负可测函数的积分扩张定理即得

$$\int_a^b f'(x)dx = \lim_{n \rightarrow +\infty} \int_{a_n}^{b_n} f'(x)dx = \lim_{n \rightarrow +\infty} [f(b_n) - f(a_n)] = f(b-) - f(a+). \quad \square$$

【例】(1) 函数 $x \mapsto \arcsin x$ 在闭区间 $[-1, 1]$ 上单调增加, 在开区间 $(-1, 1)$ 内处处可导, $\frac{d}{dx} \arcsin x = \frac{1}{\sqrt{1-x^2}}$ 。因此Newton-Leibniz公式成立:

$$\int_0^1 \frac{dx}{\sqrt{1-x^2}} = \arcsin(1) - \arcsin(0) = \frac{\pi}{2}.$$

(2) 同样, 使用单调函数的Newton-Leibniz公式有 (设 $0 < \delta < \infty$)

$$\int_0^\delta x^{-\alpha} dx = \begin{cases} \frac{\delta^{1-\alpha}}{1-\alpha} - \lim_{x \rightarrow 0+} \frac{x^{1-\alpha}}{1-\alpha} = \frac{\delta^{1-\alpha}}{1-\alpha} < \infty & \text{if } \alpha < 1 \\ \frac{\delta^{1-\alpha}}{1-\alpha} - \lim_{x \rightarrow 0+} \frac{x^{1-\alpha}}{1-\alpha} = +\infty & \text{if } \alpha > 1 \\ \log \delta - \lim_{x \rightarrow 0+} \log x = +\infty & \text{if } \alpha = 1 \end{cases}$$

$$\int_\delta^\infty x^{-\alpha} dx = \begin{cases} \lim_{x \rightarrow +\infty} \frac{x^{1-\alpha}}{1-\alpha} - \frac{\delta^{1-\alpha}}{1-\alpha} = \frac{\delta^{1-\alpha}}{\alpha-1} < \infty & \text{if } \alpha > 1 \\ \lim_{x \rightarrow +\infty} \frac{x^{1-\alpha}}{1-\alpha} - \frac{\delta^{1-\alpha}}{1-\alpha} = +\infty & \text{if } \alpha < 1 \\ \lim_{x \rightarrow +\infty} \log x - \log \delta = +\infty & \text{if } \alpha = 1 \end{cases}$$

(3) 利用积分平移变换和上面计算结果有对任意 $c \in [0, 1]$,

$$\begin{aligned} \int_0^1 |x-c|^{-\alpha} dx &= \int_{-c}^{1-c} |t|^{-\alpha} dt = \int_{-c}^0 (-t)^{-\alpha} dt + \int_0^{1-c} t^{-\alpha} dt = \int_0^c t^{-\alpha} dt + \int_0^{1-c} t^{-\alpha} dt \\ \Rightarrow \int_0^1 |x-c|^{-\alpha} dx &= \begin{cases} \frac{c^{1-\alpha} + (1-c)^{1-\alpha}}{1-\alpha} < \infty & \text{if } \alpha < 1 \\ +\infty & \text{if } \alpha \geq 1 \end{cases} \end{aligned}$$

(4)

$$\begin{aligned} \int_0^\infty \frac{dx}{1+x^2} &= \lim_{x \rightarrow +\infty} \arctan(x) - \arctan(0) = \frac{\pi}{2}, \\ \int_0^\infty e^{-\lambda x} dx &= \lim_{x \rightarrow +\infty} \frac{e^{-\lambda x}}{-\lambda} - \frac{1}{-\lambda} = \frac{1}{\lambda}, \quad \lambda = \alpha + i\beta, \quad \alpha > 0, \quad \beta \in \mathbb{R}. \end{aligned}$$

【例】

$$\begin{aligned} \int_0^\infty \frac{|\sin x|}{x} dx &= \sum_{k=1}^\infty \int_{(k-1)\pi}^{k\pi} \frac{|\sin x|}{x} dx = \sum_{k=1}^\infty \int_0^\pi \frac{|\sin(x + (k-1)\pi)|}{x + (k-1)\pi} dx \\ &= \sum_{k=1}^\infty \int_0^\pi \frac{\sin x}{x + (k-1)\pi} dx \geq \sum_{k=1}^\infty \frac{1}{k\pi} \int_0^\pi \sin x dx = \frac{2}{\pi} \sum_{k=1}^\infty \frac{1}{k} = +\infty. \end{aligned}$$

【例(Lebesgue)】 设 $f(x)$ 在有界闭区间 $[a, b]$ 上连续且单调增加. 则 $f(x)$ 在 $[a, b]$ 上几乎处处可微且成立不等式

$$\int_a^b f'(x) dx \leq f(b) - f(a).$$

此外可以构造单调增加的连续函数 $f(x)$ (如Cantor 函数) 使严格不等号“ $<$ ”成立:

$$\int_a^b f'(x) dx = 0 < f(b) - f(a).$$

【证】单调函数几乎处处可微这是Lebesgue 的著名定理, 详细证明放在关于有界变差函数类的章节中. 我们这里只给出积分不等式的证明. 如前, 做延拓 $f(x) = f(b), x \geq b$. 由 f 单调增加知 $n[f(x+1/n) - f(x)] \geq 0$, 而由单调函数几乎处处可微有

$$\frac{f(x+1/n) - f(x)}{1/n} \rightarrow f'(x) \geq 0 \quad (n \rightarrow +\infty) \quad \text{a.e.} \quad x \in [a, b].$$

于是应用Fatou 引理和前面的证明(用 f 的连续性) 有

$$\int_a^b f'(x)dx \leq \liminf_{n \rightarrow +\infty} \int_a^b \frac{f(x+1/n) - f(x)}{1/n} dx = f(b) - f(a). \quad \square$$

作为Lebesgue 控制收敛(LDC) 的一个重要应用, 我们来学习并证明含参变量积分的连续性和积分号下求微商定理.

【定理2.4.7(含参变量积分的连续性和积分号下求微商)】 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为 L -可测集, $I \subset \mathbb{R}$ 为开区间, 函数 $f: E \times I \rightarrow \mathbb{C}$.

(a) 假设对每个 $t \in I$, 函数 $x \mapsto f(x, t)$ 在 E 上 L -可积; 对每个 $x \in E$, 函数 $t \mapsto f(x, t)$ 在 I 上连续且存在 $0 \leq F \in L^1(E)$ 使得

$$|f(x, t)| \leq F(x) \quad \forall (x, t) \in E \times I.$$

则函数 $t \mapsto \int_E f(x, t)dx$ 在 I 上连续.

(b) 假设对每个 $t \in I$, 函数 $x \mapsto f(x, t)$ 在 E 上 L -可积; 对每个 $x \in E$, 函数 $t \mapsto f(x, t)$ 在 I 上可微且存在 $0 \leq G \in L^1(E)$ 使得

$$\left| \frac{\partial f}{\partial t}(x, t) \right| \leq G(x) \quad \forall (x, t) \in E \times I.$$

则函数 $t \mapsto \int_E f(x, t)dx$ 在 I 上可微, 且对每个 $t \in I$, 函数 $x \mapsto \frac{\partial f}{\partial t}(x, t)$ 在 E 上 L -可积, 并有

$$\frac{d}{dt} \int_E f(x, t)dx = \int_E \frac{\partial f}{\partial t}(x, t)dx, \quad t \in I.$$

【证】(a),(b)的证明都是连续参变量LDC的直接应用, 故只需证略微复杂的(b). 任取 $t_0 \in I$. 因 I 是开区间, 故存在 $\delta > 0$ 使得 $[t_0 - \delta, t_0 + \delta] \subset I$. 则对任意 $0 < h < \delta$, 由积分的线性性有

$$\frac{1}{h} \left(\int_E f(x, t_0 + h)dx - \int_E f(x, t_0)dx \right) = \int_E \frac{f(x, t_0 + h) - f(x, t_0)}{h} dx.$$

又由假设和微分中值不等式⁴有

$$\left| \frac{f(x, t_0 + h) - f(x, t_0)}{h} \right| \leq \left| \frac{\partial f}{\partial t}(x, \xi) \right| \leq G(x) \quad \forall x \in E, \quad \forall 0 < |h| < \delta.$$

其中 ξ 介于 $t_0, t_0 + h$ 之间因而属于 $[t_0 - \delta, t_0 + \delta] \subset I$. 又有

$$\lim_{h \rightarrow 0} \frac{f(x, t_0 + h) - f(x, t_0)}{h} = \frac{\partial f}{\partial t}(x, t_0) \quad \forall x \in E.$$

对函数族 $f_h(x) := \frac{f(x, t_0 + h) - f(x, t_0)}{h}, x \in E, h \in (-\delta, \delta) \setminus \{0\}$, 应用连续参变量的Lebesgue控制收敛定理即得

$$\begin{aligned} \lim_{h \rightarrow 0} \frac{1}{h} \left(\int_E f(x, t_0 + h) dx - \int_E f(x, t_0) dx \right) &= \lim_{h \rightarrow 0} \int_E \frac{f(x, t_0 + h) - f(x, t_0)}{h} dx \\ &= \int_E \frac{\partial f}{\partial t}(x, t_0) dx \end{aligned}$$

再由导数的定义即知函数 $t \mapsto \int_E f(x, t) dx$ 在 t_0 可导, $x \mapsto \frac{\partial f}{\partial t}(x, t_0)$ 在 E 上可积且

$$\frac{d}{dt} \int_E f(x, t) dx \Big|_{t=t_0} = \int_E \frac{\partial f}{\partial t}(x, t_0) dx.$$

最后由 $t_0 \in I$ 的任意性, 定理得证. \square

⁴当 f 为实值函数时, 是微分中值定理; 当 f 为复值函数时, 即等价地, 当 f 为向量值函数时, 是微分中值不等式.

§2.5. 连续函数逼近, 积分的平均连续性

如果被积函数是连续的函数或光滑的, 则很多性质将容易导出。下面的逼近定理表明, 在积分度量下, 可积函数可以被具有紧支集的连续函数逼近。以后会看到, 可积函数也可以被具有紧支集的 C^∞ -光滑函数逼近。

【定理2.5.1(连续函数逼近)】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $1 \leq p < \infty$, $f \in L^p(E)$. 则对任意 $\varepsilon > 0$, 存在 $g \in C_c(\mathbb{R}^d)$ 使得

$$\|f - g\|_{L^p} = \left(\int_E |f(x) - g(x)|^p dx \right)^{1/p} < \varepsilon.$$

【证】 将 f 零延拓到 \mathbb{R}^d , 即以 $\mathbf{1}_E(x)f(x)$ 代替 $f(x)$, 并注意

$$\int_E |f(x) - g(x)|^p dx \leq \int_{\mathbb{R}^d} |f(x) - g(x)|^p dx$$

则可以假设 $E = \mathbb{R}^d$. 由 $|f|^p \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 知 f 几乎处处有限。因零测集对积分无贡献, 故可以假定 f 处处有限。考虑截断逼近: $f_R(x) = f(x)\mathbf{1}_{\{|x| < R\}}\mathbf{1}_{\{|f(x)| < R\}}$. 易见

$$|f(x) - f_R(x)|^p \leq |f(x)|^p, \quad |f_R(x) - f(x)|^p \rightarrow 0 \quad (R \rightarrow +\infty) \quad \forall x \in \mathbb{R}^d.$$

因 $|f|^p \in L^1(\mathbb{R}^d)$, 故由LDC (例如可以取 R 为正整数, 或者在连续参量的LDC 中取参量为 $h = 1/R$) 有 $\|f - f_R\|_{L^p} \rightarrow 0$ ($R \rightarrow +\infty$).

对任意 $\varepsilon > 0$, 取定 $0 < R < \infty$ 充分大使得 $\|f - f_R\|_{L^p} < \varepsilon/2$. 将Lusin 定理应用于集合 $E = B_R := B(0, R)$ (开球)、函数 f_R 以及开集 $\Omega = B_R$, 则存在 $g \in C(\mathbb{R}^d)$ 满足 $\text{supp } g \subset \overline{\Omega} = \overline{B_R}$ 使得

$$m(B_R(f_R \neq g)) < \varepsilon_1 \quad \text{且} \quad \sup_{x \in \mathbb{R}^d} |g(x)| \leq \sup_{x \in B_R} |f_R(x)| \leq R.$$

这里 ε_1 是一个待定的正数, 只与 ε, R 和 p 有关. 函数 g 当然依赖于 ε_1 . 数学论证中这种“随后确定”的做法常见, 好处是使推导发展自然. 注意闭球 $\overline{B_R}$ 是紧集, 故 $\text{supp } g$ 是紧集, 因此 $g \in C_c(\mathbb{R}^d)$. 同时由 g 连续易见 $g(x) = 0$ for all $x \in \mathbb{R}^d \setminus B_R$. [事实上由 g 连续和 $g(x) = 0$ 于 $\mathbb{R}^d \setminus \overline{B_R}$ 易见 $g(x) = 0$ 于 ∂B_R . 因此 $g(x) = 0$ 于 $\mathbb{R}^d \setminus B_R$.]

我们来估计(运用三角不等式)

$$\begin{aligned} \|f - g\|_{L^p} &\leq \|f - f_R\|_{L^p} + \|f_R - g\|_{L^p} < \varepsilon/2 + \|f_R - g\|_{L^p}, \\ \|f_R - g\|_{L^p}^p &= \int_{\mathbb{R}^d} |f_R(x) - g(x)|^p dx = \int_{B_R} |f_R(x) - g(x)|^p dx \\ &= \int_{B_R(f_R \neq g)} |f_R(x) - g(x)|^p dx \leq (2R)^p m(B_R(f_R \neq g)) < (2R)^p \varepsilon_1. \end{aligned}$$

如果事先取 ε_1 满足 $(2R)^p \varepsilon_1 = (\varepsilon/2)^p$, i.e. $\varepsilon_1 = (\frac{\varepsilon}{4R})^p$, 则得到 $\|f_R - g\|_{L^p} < \varepsilon/2$. 所以 $\|f - g\|_{L^p} < \varepsilon/2 + \varepsilon/2 = \varepsilon$. \square

【定理2.5.2(平均连续性)】 设 $1 \leq p < \infty$, $f \in L^p(\mathbb{R}^d)$. 则有

$$\|f(\cdot + h) - f\|_{L^p} = \left(\int_{\mathbb{R}^d} |f(x+h) - f(x)|^p dx \right)^{1/p} \rightarrow 0 \quad \text{as } h \rightarrow 0.$$

【证】 根据极限的定义, 只要证明对任意 $\varepsilon > 0$, 存在 $\delta > 0$ 使得当 $h \in \mathbb{R}^d$ 且 $|h| < \delta$ 时

$$\|f(\cdot + h) - f\|_{L^p} = \left(\int_{\mathbb{R}^d} |f(x+h) - f(x)|^p dx \right)^{1/p} < \varepsilon.$$

由已证明的连续函数逼近, 对 $\varepsilon/3 > 0$ 存在 $g \in C_c(\mathbb{R}^d)$ 使得 $\|f - g\|_{L^p} < \varepsilon/3$. 由三角不等式和 \mathbb{R}^d 上积分的平移不变性有: $\forall h \in \mathbb{R}^d$

$$\begin{aligned} \|f(\cdot + h) - f\|_{L^p} &\leq \|f(\cdot + h) - g(\cdot + h)\|_{L^p} + \|g(\cdot + h) - g\|_{L^p} + \|g - f\|_{L^p} \\ &= 2\|f - g\|_{L^p} + \|g(\cdot + h) - g\|_{L^p} < 2\varepsilon/3 + \|g(\cdot + h) - g\|_{L^p}. \end{aligned}$$

因 g 有紧支集, 故存在 $0 < R < \infty$, 使得 $g(x) = 0 \quad \forall x \in (B_R)^c$. 同时易见 g 在 \mathbb{R}^d 一致连续. 故对任意 $\eta > 0$, 存在 $\delta > 0$ (可设 $\delta < R$), 使得当 $h \in \mathbb{R}^d$ 满足 $|h| < \delta$ 时 $|g(x+h) - g(x)| < \eta$ 对一切 $x \in \mathbb{R}^d$ 成立. 因 $g(x+h) = 0, g(x) = 0 \quad \forall x \in (B_{2R})^c$, 故当 $|h| < \delta$ 时

$$\|g(\cdot + h) - g\|_{L^p}^p = \int_{B_{2R}} |g(x+h) - g(x)|^p dx < \eta^p m(B_{2R}).$$

取 $\eta > 0$ 满足 $\eta^p m(B_{2R}) = (\varepsilon/3)^p$. 则得 $\|g(\cdot + h) - g\|_{L^p} < \varepsilon/3$ 从而有

$$\|f(\cdot + h) - f\|_{L^p} < 2\varepsilon/3 + \varepsilon/3 = \varepsilon \quad \forall |h| < \delta. \quad \square$$

• 本性有界函数空间 $L^\infty(E)$

设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, f 是 E 上的实值或复值 L -可测函数, 定义

$$f \in L^\infty(E) \iff \text{存在一个零测集 } Z \subset E \text{ 使得 } f \text{ 在 } E \setminus Z \text{ 上有界}.$$

此时我们将 f 的这种界的下确界记为 $\|f\|_{L^\infty}$, 即

$$\|f\|_{L^\infty} = \|f\|_{L^\infty(E)} := \inf_{Z \subset E, m(Z)=0} \sup_{x \in E \setminus Z} |f(x)| \quad (< \infty).$$

不难证明这个下确界 \inf 可以达到, 也即我们有: 存在零测集 $Z_0 \subset \mathbb{R}^d$ 使得

$$\|f\|_{L^\infty} = \sup_{x \in E \setminus Z_0} |f(x)|. \quad (2.5.1)$$

事实上由下确界的定义,对任意 $n \in \mathbb{N}$, 存在零测集 $Z_n \subset \mathbb{R}^d$ 使得

$$\|f\|_{L^\infty} \leq \sup_{x \in E \setminus Z_n} |f(x)| < \|f\|_{L^\infty} + \frac{1}{n}.$$

令 $Z_0 = \bigcup_{n=1}^{\infty} Z_n$, 则 $m(Z_0) = 0$ 因而据 $\|f\|_{L^\infty}$ 的定义和“小的集合其上确界也小”有

$$\|f\|_{L^\infty} \leq \sup_{x \in E \setminus Z_0} |f(x)| \leq \sup_{x \in E \setminus Z_n} |f(x)| < \|f\|_{L^\infty} + \frac{1}{n}, \quad n = 1, 2, 3, \dots$$

这蕴含(2.5.1). 数 $\|f\|_{L^\infty}$ 称为 $f \in L^\infty(E)$ 的本性界(或称为 $|f|$ 的本性上界), 其意义在积分中是明显的: 由于零测集对积分无贡献, 你可以把本性有界的被积函数当作普通有界函数对待.

注意: 若 $m(E) = 0$, 则 E 上的任何函数都属于 $L^\infty(E)$. 因此为使问题有意义, 我们假定在研究 $L^\infty(E)$ 时, $m(E) > 0$. 我们用下面定理概括 $L^\infty(E)$ 的基本性质.

【定理2.5.3】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $L^\infty(E)$ 是 E 上本质有界的实值或复值 L -可测函数的全体. 则 $L^\infty(E)$ 是一个实或复的线性空间, $\|\cdot\|_{L^\infty}$ 是 $L^\infty(E)$ 上的一个范数, 且 $L^\infty(E)$ 是一个代数, 即若 $f, g \in L^\infty(E)$, 则 $fg \in L^\infty(E)$ 且

$$\|fg\|_{L^\infty} \leq \|f\|_{L^\infty} \|g\|_{L^\infty}.$$

此外 $L^\infty(E)$ 按距离 $\|f - g\|_{L^\infty}$ 是完备的, 但当 $m(E) > 0$ 时连续函数类不在 $L^\infty(E)$ 稠密.

【证】 如前, 我们把 $L^\infty(E)$ 中几乎处处相等的两个函数看成是同一个函数. 于是易见 $\|\cdot\|_{L^\infty}$ 是 $L^\infty(E)$ 上的一个范数. 下面只需证完备性和连续函数类不在 $L^\infty(E)$ 稠密, 其他性质是显然的. 设 $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 是 $L^\infty(E)$ 中的一个 Cauchy 列, 即

$\lim_{k \rightarrow \infty, n \rightarrow \infty} \|f_k - f_n\|_{L^\infty} = 0$. 由上面分析的结果知存在零测集 $Z_{k,n} \subset E$ 使得

$$\|f_k - f_n\|_{L^\infty} = \sup_{x \in E \setminus Z_{k,n}} |f_k(x) - f_n(x)|, \quad k, n = 1, 2, 3, \dots$$

令 $Z = \bigcup_{k,n \in \mathbb{N}} Z_{k,n}$. 则 $m(Z) = 0$ 且

$$\lim_{k \rightarrow \infty, n \rightarrow \infty} \sup_{x \in E \setminus Z} |f_k(x) - f_n(x)| = 0.$$

换言之, 限制在 $E \setminus Z$ 上, $\{f_k\}_{k=1}^\infty$ 是有界函数列且满足一致收敛的 Cauchy 条件. 因此由数学分析知存在 $E \setminus Z$ 上的有界函数 f 使得 f_k 在 $E \setminus Z$ 上一致收敛于 f , 即

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \sup_{x \in E \setminus Z} |f_k(x) - f(x)| = 0.$$

如令 $f(x) = 0$ 于 Z , 则 f 是 E 上的可测函数且 $f \in L^\infty(E)$ 并由 $m(Z) = 0$ 有

$$\|f_k - f\|_{L^\infty} \leq \sup_{x \in E \setminus Z} |f_k(x) - f(x)| \rightarrow 0 \quad (k \rightarrow \infty).$$

所以 $\|f_k - f\|_{L^\infty} \rightarrow 0$ ($k \rightarrow \infty$). 所以 $L^\infty(E)$ 是完备的。

下面设 $m(E) > 0$, 来构造一个函数 $f \in L^\infty(E)$ 使得

$$\|g - f\|_{L^\infty} \geq \frac{1}{2} \quad \forall g \in C(E) \cap L^\infty(E).$$

由 $m(E) > 0$ 可知 E 中几乎每一点都是全密点(见第三章§3.1), 这特别蕴含存在零测集 $Z_1 \subset E$ 使得对任意 $x \in E \setminus Z_1$ 和任意 $r > 0$ 有 $m(E \cap B(x, r)) > 0$. 周知有理点集 \mathbb{Q}^d 是可数的稠密集, 因此作为数学分析的练习易证 $E \setminus Z_1$ 有一个可数稠密子集: $A = \{a_k\}_{k=1}^\infty$ 其中 a_k 互不相同. 考虑 $\Omega = \bigcup_{k=1}^\infty B(a_k, \frac{\varepsilon}{2^k})$, $0 < \varepsilon < 1$. 则有 $m(\Omega) \leq \sum_{k=1}^\infty m(B(a_k, \frac{\varepsilon}{2^k})) = C_d \sum_{k=1}^\infty (\frac{\varepsilon}{2^k})^d \leq C_d \varepsilon$, 其中 $C_d = m(\mathbb{B}^d)$ 等于单位球的测度. 取 ε 充分小使得 $C_d \varepsilon < \frac{1}{2}m(E)$. 则得知 $m(\Omega) < \frac{1}{2}m(E)$. 令

$$K = E \setminus \Omega, \quad f(x) = \mathbf{1}_K(x).$$

则由 $E \subset K \cup \Omega$ 知 $m(K) > 0$. 来证明对任意 $g \in C(E) \cap L^\infty(E)$ 有 $\|g - f\|_{L^\infty} \geq 1/2$. 首先由上面分析的结果知存在零测集 $Z_0 \subset E$ 使得 $\|g - f\|_{L^\infty} = \sup_{x \in E \setminus Z_0} |f(x) - g(x)|$. 于是为证这一性质, 我们用反证法: 假设 $\sup_{x \in E \setminus Z_0} |f(x) - g(x)| < 1/2$, 来导出矛盾. 令

$$Z_* = Z_0 \cup Z_1 \cup A.$$

则 $m(Z_*) = 0$. 这蕴含 $K \setminus Z_* \neq \emptyset$. 取 $x_0 \in K \setminus Z_*$. 由 $A = \{a_k\}_{k=1}^\infty$ 在 $E \setminus Z_1$ 中稠密、 $x_0 \in E \setminus Z_1$ 和 $x_0 \notin A$ 知存在子列 $\{a_{k_j}\}_{j=1}^\infty$ 使得 $a_{k_j} \rightarrow x_0$ ($j \rightarrow \infty$) 这里 $k_1 < k_2 < k_3 < \dots$.⁵ 其次由 $m(E \cap B(a_{k_j}, \frac{\varepsilon}{2^{k_j}})) > 0$ 知 $E \cap B(a_{k_j}, \frac{\varepsilon}{2^{k_j}}) \setminus Z_* \neq \emptyset$, 因此可以取定 $x_j \in E \cap B(a_{k_j}, \frac{\varepsilon}{2^{k_j}}) \setminus Z_*$, $j = 1, 2, 3, \dots$. 这蕴含 $|x_j - x_0| \leq |x_j - a_{k_j}| + |a_{k_j} - x_0| \leq \frac{\varepsilon}{2^{k_j}} + |a_{k_j} - x_0| \rightarrow 0$ ($j \rightarrow \infty$). 因 g 连续, 故 $g(x_0) = \lim_{j \rightarrow \infty} g(x_j)$. 又由 Ω 的定义知 $x_j \in E \cap \Omega \setminus Z_*$ 因此 $x_j \notin K$ 从而有 $f(x_j) = 0$ 和

$$|g(x_j)| = |g(x_j) - f(x_j)| \leq \sup_{x \in E \setminus Z_0} |g(x) - f(x)| < 1/2, \quad j = 1, 2, 3, \dots$$

⁵因 $x_0 \notin A$, 故 $|a_k - x_0| > 0$ for all $k \in \mathbb{N}$. 由 $A = \{a_k\}_{k=1}^\infty$ 的稠密性易见依次存在 $k_1, k_2, k_3, \dots \in \mathbb{N}$ 使得 $k_1 = 1$, $0 < |a_{k_j} - x_0| \leq \frac{1}{j} \min_{1 \leq k \leq k_{j-1}} \frac{|a_k - x_0|}{1 + |a_k - x_0|}$, $j = 2, 3, 4, \dots$. 这蕴含 $k_1 < k_2 < k_3 < \dots$ 且 $|a_{k_j} - x_0| \leq \frac{1}{j} \rightarrow 0$ ($j \rightarrow \infty$).

这蕴含 $|g(x_0)| = \lim_{j \rightarrow \infty} |g(x_j)| \leq \frac{1}{2}$. 又由 $x_0 \in K \setminus Z_*$ 知 $f(x_0) = 1$. 于是得到矛盾:

$$1 \leq |1 - g(x_0)| + |g(x_0)| \leq |f(x_0) - g(x_0)| + 1/2 \leq \sup_{x \in E \setminus Z_0} |f(x) - g(x)| + 1/2 < 1.$$

这矛盾证明了必有 $\|g - f\|_{L^\infty} \geq 1/2$. \square

§2.6. 重积分和累次积分, Fubini 定理

为了利用一元函数的Newton-Leibniz 公式计算多元函数的重积分, 需要把重积分化为一些低维集合上的累次积分。理论上必须保证累次积分的计算结果与累积次序的选择无关。Fubini定理表明: 只要被积函数整体可积或非负可测, 重积分就与累次积分的次序无关。在重积分的计算和估值方面, 由于被积函数千差万别, 不同的累次积分顺序可能带来不同的难度, 而且理论和实践表明: 重积分的某些重要性质只有在合适的累次积分顺序上才能展现出来。因此选择合适的累次积分顺序是重积分计算与应用的要点之一。

为建立重积分与累次积分的关系式, 我们从特征函数的重积分和累次积分开始。

记号: 令 $m_d(\cdot)$ 为 \mathbb{R}^d 上的Lebesgue 测度. 注意若 $p, q \in \mathbb{N}$, 则 $\mathbb{R}^{p+q} = \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q$.

【集合的截口】 对任一集合 $E \subset \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q$, 定义截口 E_x, E^y 如下:

$$E_x = \{y \in \mathbb{R}^q \mid (x, y) \in E\}, \quad x \in \mathbb{R}^p; \quad E^y = \{x \in \mathbb{R}^p \mid (x, y) \in E\}, \quad y \in \mathbb{R}^q.$$

$$\text{易见} \quad \mathbf{1}_E(x, y) = \mathbf{1}_{E_x}(y) = \mathbf{1}_{E^y}(x) \quad \forall (x, y) \in \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q.$$

给定 $x \in \mathbb{R}^p$, 我们考察函数 $y \mapsto \mathbf{1}_{E_x}(y)$ 在 \mathbb{R}^q 上是否可测, 也即是否 $E_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$. 如果 $E_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$, 则有

$$m_q(E_x) = \int_{\mathbb{R}^q} \mathbf{1}_{E_x}(y) dy = \int_{\mathbb{R}^q} \mathbf{1}_E(x, y) dy.$$

进一步, 如果对每个 $x \in \mathbb{R}^p$, 都有 $E_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$, 则可以进一步考察函数

$$x \mapsto m_q(E_x) = \int_{\mathbb{R}^q} \mathbf{1}_E(x, y) dy$$

的可测性以及当可测时其积分的计算问题. 对于截口 E^y , 上述问题和过程是一样的.

下面的命题表明, 假如 $E \subset \mathbb{R}^{p+q}$ 是 $p+q$ 维 L -可测集, 即 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^{p+q})$, 则上述问题的回答都至少是“几乎”肯定的.

【命题2.6.1】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^{p+q})$. 则 E 具有下列性质:

(i) 对几乎所有 $x \in \mathbb{R}^p$ 都有 $E_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$,

对几乎所有 $y \in \mathbb{R}^q$ 都有 $E^y \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^p)$.

(ii) $x \mapsto m_q(E_x) = \int_{\mathbb{R}^q} \mathbf{1}_E(x, y) dy$ 是 \mathbb{R}^p 上的可测函数,

$y \mapsto m_p(E^y) = \int_{\mathbb{R}^p} \mathbf{1}_E(x, y) dx$ 是 \mathbb{R}^q 上的可测函数.

(iii)

$$\int_{\mathbb{R}^p} m_q(E_x) dx = \int_{\mathbb{R}^q} m_p(E^y) dy = m_{p+q}(E)$$

也即

$$\int_{\mathbb{R}^p} \left(\int_{\mathbb{R}^q} \mathbf{1}_E(x, y) dy \right) dx = \int_{\mathbb{R}^q} \left(\int_{\mathbb{R}^p} \mathbf{1}_E(x, y) dx \right) dy = \iint_{\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q} \mathbf{1}_E(x, y) dx dy.$$

【证】由于两个截面 E_x, E^y 地位相同, 故只需证明(例如)关于 E_x 的上述性质. 令 $(i)_x, (ii)_x, (iii)_x$ 表示(i),(ii),(iii)中关于截面 E_x 的性质. 令

$$\mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q}) = \{E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^{p+q}) \mid E \text{ 具有性质 } (i)_x, (ii)_x, (iii)_x\}.$$

则我们要证明 $\mathcal{M}(\mathbb{R}^{p+q}) = \mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$.

为此我们将依次证明:

区间和 G_δ -型集都属于 $\mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$ 且此时(i) 中的“几乎所有”实为“所有”;

每个零测集属于 $\mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$;

每个可测集属于 $\mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$.

首先由截口的定义容易验证: 对任意集合 $E_k, A, B, \subset \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q$ 和任意 $x \in \mathbb{R}^p$ 有

$$\begin{aligned} \left(\bigcup_{k \geq 1} E_k \right)_x &= \bigcup_{k \geq 1} (E_k)_x, & \left(\bigcap_{k \geq 1} E_k \right)_x &= \bigcap_{k \geq 1} (E_k)_x, \\ (A \setminus B)_x &= A_x \setminus B_x, & A \subset B &\implies A_x \subset B_x. \end{aligned}$$

此外, 空集的截面是空集.

设 $Q = I \times J$ 是 $\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q = \mathbb{R}^{p+q}$ 中的任一区间. 则

$$Q_x = \begin{cases} J & \text{if } x \in I \\ \emptyset & \text{if } x \notin I \end{cases}$$

所以 $Q_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$ for all $x \in \mathbb{R}^p$. 同时由

$$m_q(Q_x) = \begin{cases} m_q(J) & \text{if } x \in I \\ 0 & \text{if } x \notin I \end{cases}$$

可知 $x \mapsto m_q(Q_x)$ 在 \mathbb{R}^p 上可测且

$$\int_{\mathbb{R}^p} m_q(Q_x) dx = \int_I m_q(J) dx = m_p(I) m_q(J) = |I| |J| = |Q| = m_{p+q}(Q).$$

所以 $Q \in \mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$.

设 $\Omega \subset \mathbb{R}^{p+q}$ 是任一开集. 由开集分解定理有 $\Omega = \bigcup_{k=1}^{\infty} Q_k$ 其中 Q_k 是互不相交的(左闭右开的) 区间. 由

$$\Omega_x = \bigcup_{k=1}^{\infty} (Q_k)_x, \quad x \in \mathbb{R}^p.$$

知 $\Omega_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$ for all $x \in \mathbb{R}^p$. 同时由 Q_k 互不相交知截口 $(Q_k)_x$ 也互不相交. 于是由可加性得

$$m_q(\Omega_x) = \sum_{k=1}^{\infty} m_q((Q_k)_x), \quad x \in \mathbb{R}^p.$$

因每个函数 $x \mapsto m_q((Q_k)_x)$ 在 \mathbb{R}^p 上非负可测, 故 $x \mapsto m_q(\Omega_x)$ 在 \mathbb{R}^p 上可测. 对 $m_q(\Omega_x) = \sum_{k=1}^{\infty} m_q((Q_k)_x)$ 逐项积分得到

$$\int_{\mathbb{R}^p} m_q(\Omega_x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} \int_{\mathbb{R}^p} m_q((Q_k)_x) dx = \sum_{k=1}^{\infty} m_{p+q}(Q_k) = m_{p+q}(\Omega).$$

所以 $\Omega \in \mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$.

设 $H = \bigcap_{k=1}^{\infty} \Omega_k$ 其中 $\Omega_k \subset \mathbb{R}^{p+q}$ 是开集且 $\Omega_1 \supset \Omega_2 \supset \Omega_3 \supset \dots$. 由 $\Omega_k \in \mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$ 有: $H_x = \bigcap_{k=1}^{\infty} (\Omega_k)_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$ for all $x \in \mathbb{R}^p$, 且 $(\Omega_1)_x \supset (\Omega_2)_x \supset (\Omega_3)_x \supset \dots$.

现假设 Ω_1 有界. 则截口 $(\Omega_1)_x$ 也有界. 因此由测度的单调收敛定理 \implies

$$m_q(H_x) = \lim_{k \rightarrow \infty} m_q((\Omega_k)_x) \quad \forall x \in \mathbb{R}^p.$$

因可测函数的极限函数还是可测函数, 故函数 $x \mapsto m_q(H_x)$ 在 \mathbb{R}^p 上可测. 注意 Ω_1 有界 \implies 函数 $x \mapsto m_q((\Omega_1)_x)$ 在 \mathbb{R}^p 上 L -可积:

$$\int_{\mathbb{R}^p} m_q((\Omega_1)_x) dx = m_{p+q}(\Omega_1) < \infty.$$

因 $m_q((\Omega_k)_x) \leq m_q((\Omega_1)_x)$ 故由LDC 和测度的单调收敛定理得

$$\int_{\mathbb{R}^p} m_q(H_x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} \int_{\mathbb{R}^p} m_q((\Omega_k)_x) dx = \lim_{k \rightarrow \infty} m_{p+q}(\Omega_k) = m_{p+q}(H).$$

如果 Ω_1 无界, 则考虑截断逼近: 令

$$H_n = H \cap (-n, n)^{p+q} = \bigcap_{k=1}^{\infty} \Omega_{k,n}, \quad \Omega_{k,n} = \Omega_k \cap (-n, n)^{p+q}, \quad n \in \mathbb{N}.$$

此时对每个 $n \in \mathbb{N}$ 和 $x \in \mathbb{R}^p$ 都有 $(H_n)_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$. 易见

$$H_1 \subset H_2 \subset H_3 \subset \dots, \quad H = \bigcup_{n=1}^{\infty} H_n$$

从而有

$$(H_1)_x \subset (H_2)_x \subset (H_3)_x \subset \cdots, \quad H_x = \bigcup_{n=1}^{\infty} (H_n)_x.$$

因此对每个 $x \in \mathbb{R}^p$ 都有 $H_x = \bigcup_{n=1}^{\infty} (H_n)_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$; 同时由测度的单调收敛定理知 $m_q(H_x) = \lim_{n \rightarrow \infty} m_q((H_n)_x)$. 因可测函数的极限函数还是可测函数, 故这表明 $x \mapsto m_q(H_x)$ 在 \mathbb{R}^p 上可测. 于是由Levi 单调收敛定理和测度的单调收敛定理得到

$$\int_{\mathbb{R}^p} m_q(H_x) dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{\mathbb{R}^p} m_q((H_n)_x) dx = \lim_{n \rightarrow \infty} m_{p+q}(H_n) = m_{p+q}(H).$$

所以 $H \in \mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$.

设 $E \subset \mathbb{R}^{p+q}$ 为零测集. 由Lebesgue 可测集的结构知, 存在一列递减的开集 $\Omega_1 \supset \Omega_2 \supset \Omega_3 \supset \cdots$ 使得 $E \subset H := \bigcap_{k=1}^{\infty} \Omega_k$ 且 $m_{p+q}(H) = 0$. 上面已证明了 $H \in \mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$. 因此

$$\int_{\mathbb{R}^p} m_q(H_x) dx = m_{p+q}(H) = 0.$$

由此可知 $m_q(H_x) = 0$ a.e. $x \in \mathbb{R}^p$. 但 $E_x \subset H_x$, 故 $m_q(E_x) = 0$ a.e. $x \in \mathbb{R}^p$. 意即对几乎所有 $x \in \mathbb{R}^p$, E_x 是 \mathbb{R}^q 中的零测集. 因此对几乎所有 $x \in \mathbb{R}^p$, $E_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$. 显然函数 $x \mapsto m_q(E_x)$ 在 \mathbb{R}^p 上可测(几乎处处=0). 所以 $E \in \mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$.

最后设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^{p+q})$ 为一般集合. 由Lebesgue 可测集的结构知, 存在一列递减的开集 $\Omega_1 \supset \Omega_2 \supset \Omega_3 \supset \cdots$ 和一个零测集 Z 使得 $E = H \setminus Z$, 其中 $H := \bigcap_{k=1}^{\infty} \Omega_k$. 上面已证明了 $H, Z \in \mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$. 因此由 $E_x = H_x \setminus Z_x$ 知对几乎所有 $x \in \mathbb{R}^p$ 有 $H_x, Z_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$ 且 $m_q(Z_x) = 0$. 所以对几乎所有 $x \in \mathbb{R}^p$ 有 $E_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$ 且 $m_q(E_x) = m_q(H_x)$. 因此函数 $x \mapsto m_q(E_x)$ 在 \mathbb{R}^p 上可测. 再借助 $H \in \mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$ 得到

$$\int_{\mathbb{R}^p} m_q(E_x) dx = \int_{\mathbb{R}^p} m_q(H_x) dx = m_{p+q}(H) = m_{p+q}(E).$$

所以 $E \in \mathcal{M}_0(\mathbb{R}^{p+q})$. 命题至此证毕. \square

【命题2.6.2(乘积集合的可测性和测度)】

设 $p, q \in \mathbb{N}$, $A \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^p)$, $B \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$, 则 $A \times B \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^{p+q})$ 且

$$m_{p+q}(A \times B) = m_p(A)m_q(B).$$

【证】根据Lebesgue 可测集的结构我们有分解:

$$A = \bigcup_{i=1}^{\infty} K_{p,i} \bigcup Z_p, \quad B = \bigcup_{i=1}^{\infty} K_{q,i} \bigcup Z_q,$$

$$\implies A \times B = \bigcup_{i=1}^{\infty} \bigcup_{j=1}^{\infty} (K_{p,i} \times K_{q,j}) \bigcup (A \times Z_q) \bigcup (Z_p \times B).$$

其中 $K_{p,i} \subset \mathbb{R}^p, K_{q,j} \subset \mathbb{R}^q$ 均为紧集, $Z_p \subset \mathbb{R}^p, Z_q \subset \mathbb{R}^q$ 是 L -零测集. 因 $K_{p,i} \times K_{q,j}$ 是 $\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q = \mathbb{R}^{p+q}$ 中的紧集从而是 L -可测集, 故可数个紧集的并 $\bigcup_{i=1}^{\infty} \bigcup_{j=1}^{\infty} (K_{p,i} \times K_{q,j})$ 是 \mathbb{R}^{p+q} 中的 L -可测集. 而由**命题1.4.7(Lebesgue零测集的基本性质)**知 $A \times Z_q, Z_p \times B$ 是 \mathbb{R}^{p+q} 中的 L -零测集. 所以 $A \times B$ 是 \mathbb{R}^{p+q} 中的 L -可测集.

为计算 $m_{p+q}(A \times B)$, 注意

$$\mathbf{1}_{A \times B}(x, y) = \mathbf{1}_A(x) \mathbf{1}_B(y), \quad (x, y) \in \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q = \mathbb{R}^{p+q}$$

因此由**命题2.6.1**有

$$\begin{aligned} m_{p+q}(A \times B) &= \iint_{\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q} \mathbf{1}_{A \times B}(x, y) dx dy = \int_{\mathbb{R}^q} \left(\int_{\mathbb{R}^p} \mathbf{1}_A(x) \mathbf{1}_B(y) dx \right) dy \\ &= \int_{\mathbb{R}^q} \left(\mathbf{1}_B(y) \int_{\mathbb{R}^p} \mathbf{1}_A(x) dx \right) dy = \int_{\mathbb{R}^q} m_p(A) \mathbf{1}_B(y) dy \\ &= m_p(A) \int_{\mathbb{R}^q} \mathbf{1}_B(y) dy = m_p(A) m_q(B). \quad \square \end{aligned}$$

【Fubini 定理】 设 $p, q \in \mathbb{N}$, $X \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^p), Y \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$, 并设 $f(x, y)$ 是 $(x, y) \in X \times Y$ 的广义实值函数或复值函数. 若 f 在 $X \times Y$ 上 L -非负可测或者 $f \in L^1(X \times Y)$, 则有

$$\iint_{X \times Y} f(x, y) dx dy = \int_X \left(\int_Y f(x, y) dy \right) dx = \int_Y \left(\int_X f(x, y) dx \right) dy. \quad (2.6.1)$$

这里关于 f 分别对 x 和 y 的可测性以及内层积分 $x \mapsto \int_Y f(x, y) dy, y \mapsto \int_X f(x, y) dx$ 的可测性有如下详细结果:

(I) 若 f 在 $X \times Y$ 上非负可测, 则

(I.1) 对于几乎所有 $x \in X$, 函数 $y \mapsto f(x, y)$ 在 Y 上非负可测;

对于几乎所有 $y \in Y$, 函数 $x \mapsto f(x, y)$ 在 X 上可测.

(I.2) 两个内层积分

$$x \mapsto \int_Y f(x, y) dy, \quad y \mapsto \int_X f(x, y) dx$$

分别在 X 上和 Y 上非负可测.

(II) 若 $f \in L^1(X \times Y)$, 则

(II.1) 对于几乎所有 $x \in X$, 函数 $y \mapsto f(x, y)$ 在 Y 上 L -可积;

对于几乎所有 $y \in Y$, 函数 $x \mapsto f(x, y)$ 在 X 上 L -可积.

(II.2) 两个内层积分

$$x \mapsto \int_Y f(x, y) dy, \quad y \mapsto \int_X f(x, y) dx$$

分别在 X 和 Y 上 L -可积.

【注】

1. 由上一命题和 $X \times Y \subset \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q = \mathbb{R}^{p+q}$ 知 $X \times Y$ 是 \mathbb{R}^{p+q} 中的 Lebesgue 可测集, 即 $X \times Y \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^{p+q})$.

2. 双重积分符号 $\iint_{X \times Y} f(x, y) dx dy$, $\iint_{X_1 \times X_2} f(x_1, x_2) dx_1 dx_2$ 等等, 只是习惯写法, 它们本身还是多元整体积分, 而不是累次积分(虽然有提示累次积分的作用). 因此可以把它们还原成以前的写法, 例如

$$\iint_{X_1 \times X_2} f(x_1, x_2) dx_1 dx_2 = \int_{X_1 \times X_2} f(x) dx$$

其中

$$x = (x_1, x_2) \in X_1 \times X_2 \subset \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q, \quad dx = dx_1 dx_2 \text{ 为 } p+q \text{ 维的 } L\text{-测度元}.$$

3. Fubini 定理不光是处理累次积分的, 它还给出了多元可测函数的“偏”可测性! 这种偏可测性不仅保证了累次积分有意义, 而且有其它用途.

4. 累次积分的另一常用写法为

$$\int_X dx \int_Y f(x, y) dy := \int_X \left(\int_Y f(x, y) dy \right) dx, \quad (2.6.2)$$

$$\int_Y dy \int_X f(x, y) dx := \int_Y \left(\int_X f(x, y) dx \right) dy. \quad (2.6.3)$$

这个写法的优点是既保持了累次结构和顺序又不用加括号, 因此适于多层累次积分的表示. 以上两种写法经常同时使用. 初学时建议先使用加括号的形式以确保层次清楚, 待熟悉之后再使用不加括号的形式.

5. 当被积函数 $f \geq 0$ 时, Fubini 定理也称为 Tonelli 定理. 所以有些教科书将非负可测函数的 Fubini 定理称为 Fubini-Tonelli 定理.

6. 对于 $X \times Y$ 上的非负可测函数 $f(x, y)$, 根据Fubini 定理, 内层积分 $F_f(x) := \int_Y f(x, y)dy$ 对所有 $x \in X \setminus Z$ 存在, 其中 Z 是一个零测集. 如果我们在 Z 上对 F_f 补充定义, 例如当 Z 中的每一点都是 $X \setminus Z$ 的极限点时定义

$$F_f(x) := \liminf_{X \setminus Z \ni \tilde{x} \rightarrow x} F_f(\tilde{x}), \quad x \in Z.$$

或对一般情形干脆定义

$$F_f(x) := 0, \quad x \in Z.$$

则 F_f 在 X 上处处有定义. 结论(I.2) 的精确说法是: 补充定义后的函数 F_f 在 X 上非负可测. 因零测集对积分没有贡献, 故

$$\int_X F_f(x)dx = \int_{X \setminus Z} \left(\int_Y f(x, y)dy \right) dx.$$

同样由于 Z 是零测集, 我们可以将 F_f 在 $x \in Z$ 处的值形式上仍记为 $\int_Y f(x, y)dy$, 从而有

$$\int_X \left(\int_Y f(x, y)dy \right) dx = \int_{X \setminus Z} \left(\int_Y f(x, y)dy \right) dx.$$

对于 $f \in L^1(X \times Y)$ 的情形, 因 $f(x)$ 的实部 $\operatorname{Re}(f(x))$ 、虚部 $\operatorname{Im}(f(x))$ 的正、负部 $\operatorname{Re}^\pm(f(x))$, $\operatorname{Im}^\pm(f(x))$ 都是 $X \times Y$ 上的非负可测函数, 所以上述修正过程可用于 $\int_Y \operatorname{Re}^\pm(f(x))dy$ 和 $\int_Y \operatorname{Im}^\pm(f(x))dy$.

实际上, 根据可测函数的性质我们知道, 可测函数可以在一个零测集上没有定义, 这是因为在零测集上无论怎样补充定义或任意修改其值, 都不影响可测性. 因此, 由于零测集对积分无贡献, 无论是否做上述修正都不影响Fubini定理的结论.

【Fubini 定理的证明】 如果将 $f(x, y)$ 零延拓到 $\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q$ 上, 也即以

$$\tilde{f}(x, y) = \mathbf{1}_{X \times Y}(x, y)f(x, y) = \mathbf{1}_X(x)\mathbf{1}_Y(y)f(x, y), \quad (x, y) \in \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q$$

代替 $f(x, y)$, 则我们可以不失一般性地假定 $X = \mathbb{R}^p, Y = \mathbb{R}^q$.

由于Fubini 定理中两个累次积分和相应的可测性地位对称, 我们只需就其中一种累次积分和相关的可测性进行证明即可.

(I) 非负可测的情形. 设 $f(x, y)$ 在 $\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q$ 上非负可测. 由非负可测函数的级数表示, 在一列常数 $0 < c_k < \infty$ 和可测集 $E_k \subset \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q$ 使得

$$f(x, y) = \sum_{k=1}^{\infty} c_k \mathbf{1}_{E_k}(x, y) \quad \forall (x, y) \in \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q.$$

对每个 E_k , 由 **命题2.5.1**, 存在零测集 $Z_k \subset \mathbb{R}^p$ 使得对每个 $x \in \mathbb{R}^p \setminus Z_k$, 截面 $(E_k)_x \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$, 且函数

$$x \mapsto F_k(x) := m_q((E_k)_x) = \int_{\mathbb{R}^q} \mathbf{1}_{E_k}(x, y) dy$$

在 \mathbb{R}^p 上非负可测. 此外还有

$$\int_{\mathbb{R}^p} F_k(x) dx = \int_{\mathbb{R}^p} \left(\int_{\mathbb{R}^q} \mathbf{1}_{E_k}(x, y) dy \right) dx = \iint_{\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q} \mathbf{1}_{E_k}(x, y) dx dy.$$

令 $Z = \bigcup_{k=1}^{\infty} Z_k$, 则 Z 是 \mathbb{R}^p 中的零测集且 $\forall x \in \mathbb{R}^p \setminus Z$, 所有函数 $y \mapsto \mathbf{1}_{E_k}(x, y)$ 都在 \mathbb{R}^q 上非负可测. 因此由非负可测的函数级数是可测函数知 $\forall x \in \mathbb{R}^p \setminus Z$, 函数

$$y \mapsto f(x, y) = \sum_{k=1}^{\infty} c_k \mathbf{1}_{E_k}(x, y)$$

在 \mathbb{R}^q 上非负可测. 应用非负可测函数的逐项积分有

$$\int_{\mathbb{R}^q} f(x, y) dy = \sum_{k=1}^{\infty} c_k \int_{\mathbb{R}^q} \mathbf{1}_{E_k}(x, y) dy = \sum_{k=1}^{\infty} c_k F_k(x), \quad \forall x \in \mathbb{R}^p \setminus Z.$$

同理, 由于所有函数 F_k ($k = 1, 2, \dots$) 都在 \mathbb{R}^p 上非负可测且零测集不影响可测性, 所以函数

$$x \mapsto \int_{\mathbb{R}^q} f(x, y) dy = \sum_{k=1}^{\infty} c_k F_k(x)$$

在 \mathbb{R}^p 上非负可测并由非负可测函数级数的逐项积分得到

$$\begin{aligned} \int_{\mathbb{R}^p} \left(\int_{\mathbb{R}^q} f(x, y) dy \right) dx &= \int_{\mathbb{R}^p} \left(\sum_{k=1}^{\infty} c_k F_k(x) \right) dx = \sum_{k=1}^{\infty} c_k \int_{\mathbb{R}^p} F_k(x) dx \\ &= \sum_{k=1}^{\infty} c_k \iint_{\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q} \mathbf{1}_{E_k}(x, y) dx dy = \iint_{\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q} f(x, y) dx dy. \end{aligned}$$

(II) 可积的情形. 设实值函数 $f \in L^1(\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q)$. 因 f 的正、负部 f^+, f^- 都是非负可测函数, 故上面第(I)部分对于 f^+ 和 f^- 成立. 又因 $f^{\pm} \leq |f|$, 故

$$\int_X dx \int_Y f^{\pm}(x, y) dy = \iint_{X \times Y} f^{\pm}(x, y) dx dy < \infty. \quad (2.6.4)$$

因此存在零测集 $Z^{\pm} \subset \mathbb{R}^p$ 使得内层积分存在有限:

$$\int_{\mathbb{R}^q} f^{\pm}(x, y) dy < \infty \quad \forall x \in \mathbb{R}^p \setminus Z^{\pm}.$$

因可积函数的线性组合还是可积函数, 故

$\forall x \in \mathbb{R}^p \setminus (Z^+ \cup Z^-)$, 函数 $y \mapsto f(x, y) = f^+(x, y) - f^-(x, y)$ 在 \mathbb{R}^q 上 L -可积,

又由第(I)部分和可积性(2.6.4)有: 内层积分

$$x \mapsto \int_{\mathbb{R}^q} f^+(x, y) dy, \quad x \mapsto \int_{\mathbb{R}^q} f^-(x, y) dy$$

在 \mathbb{R}^p 上 L -可积, 因此内层积分

$$x \mapsto \int_{\mathbb{R}^q} f(x, y) dy = \int_{\mathbb{R}^q} f^+(x, y) dy - \int_{\mathbb{R}^q} f^-(x, y) dy$$

在 \mathbb{R}^p 上 L -可积. 于是有

$$\begin{aligned} \iint_{\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q} f(x, y) dx dy &= \iint_{\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q} f^+(x, y) dx dy - \iint_{\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q} f^-(x, y) dx dy \\ &= \int_{\mathbb{R}^p} \left(\int_{\mathbb{R}^q} f^+ dy \right) dx - \int_{\mathbb{R}^p} \left(\int_{\mathbb{R}^q} f^- dy \right) dx = \int_{\mathbb{R}^p} \left(\int_{\mathbb{R}^q} f^+ dy - \int_{\mathbb{R}^q} f^- dy \right) dx \\ &= \int_{\mathbb{R}^p} \left(\int_{\mathbb{R}^q} [f^+(x, y) - f^-(x, y)] dy \right) dx = \int_{\mathbb{R}^p} \left(\int_{\mathbb{R}^q} f(x, y) dy \right) dx. \end{aligned}$$

最后设复值函数 $f \in L^1(\mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q)$. 因 f 的实部 $\operatorname{Re}(f)$ 和虚部 $\operatorname{Im}(f)$ 都是实值可积函数, 故将上面关于实值可积函数的性质应用于 $\operatorname{Re}(f)$, $\operatorname{Im}(f)$, 并根据复值函数的积分的定义即知定理中的性质(II) 和(2.6.1) 对于复值可积函数也成立. \square

作为Fubini 定理的重要推论, 下面三个性质在判断整体可积方面是经常使用的.

【Fubini 定理的推论1】 设 $p, q \in \mathbb{N}$, $X \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^p)$, $Y \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$, 并设 $f(x, y)$ 是 $X \times Y$ 上的实值或复值可测函数, 满足

$$\text{或者 } \int_X \left(\int_Y |f(x, y)| dy \right) dx < \infty, \quad \text{或者 } \int_Y \left(\int_X |f(x, y)| dx \right) dy < \infty.$$

则 f 在 $X \times Y$ 上 L -可积, 即 $f \in L^1(X \times Y)$. 因此 f 具有Fubini 定理中的所有性质(即 f 具有部分可测性且重积分等于累次积分的叠加).

【证】 将Fubini 定理应用于非负可测函数 $|f(x, y)|$ 有

$$\iint_{X \times Y} |f(x, y)| dx dy = \int_X \left(\int_Y |f(x, y)| dy \right) dx = \int_Y \left(\int_X |f(x, y)| dx \right) dy < \infty.$$

因 f 已在 $X \times Y$ 上可测, 故 $f \in L^1(X \times Y)$. \square

下面例子说明Fubini定理中的条件——整体可积或整体非负可测——不能再减弱.

【例】 设

$$f(x, y) = \frac{x^2 - y^2}{(x^2 + y^2)^2}, \quad (x, y) \in (0, 1) \times (0, 1).$$

则 f 连续从而可测. 同时有

$$\int_0^1 f(x, y) dy = \frac{1}{1+x^2}, \quad x \in (0, 1); \quad \int_0^1 f(x, y) dx = \frac{-1}{1+y^2}, \quad y \in (0, 1)$$

因此

$$\int_0^1 \left(\int_0^1 f(x, y) dy \right) dx = \frac{\pi}{4}, \quad \int_0^1 \left(\int_0^1 f(x, y) dx \right) dy = -\frac{\pi}{4}.$$

因此

$$\int_0^1 \left(\int_0^1 f(x, y) dy \right) dx \neq \int_0^1 \left(\int_0^1 f(x, y) dx \right) dy.$$

根据Fubini 定理知 $f(x, y)$ 必定不是整体可积的, 也即必定有

$$\int_0^1 \int_0^1 |f(x, y)| dx dy = +\infty.$$

【证】对任意 $0 < x, a \leq 1$ 计算

$$\int_0^a f(x, y) dy = \int_0^a \frac{x^2 - y^2}{(x^2 + y^2)^2} dy = \frac{y}{x^2 + y^2} \Big|_{y=0}^{y=a} = \frac{a}{x^2 + a^2}.$$

有这一结果有

$$\int_0^a f(x, y) dx = - \int_0^a f(y, x) dx = -\frac{a}{y^2 + a^2}.$$

取 $a = 1$ 就得到例题中两个单层积分的结果.

为证 f 在 $(0, 1) \times (0, 1)$ 上不可积, 我们取 $a = x \in (0, 1)$. 此时有

$$\begin{aligned} \int_0^x f(x, y) dy = \frac{1}{2x} &\implies \int_0^1 |f(x, y)| dy \geq \int_0^x |f(x, y)| dy \geq \frac{1}{2x} \\ &\implies \int_0^1 \left(\int_0^1 |f(x, y)| dy \right) dx \geq \int_0^1 \frac{1}{2x} dx = +\infty. \end{aligned}$$

因此由非负可测函数的Fubini 定理有

$$\int_0^1 \int_0^1 |f(x, y)| dx dy = \int_0^1 \left(\int_0^1 |f(x, y)| dy \right) dx = +\infty. \quad \square$$

【注】Fubini 定理的一个大前提是函数 $(x, y) \mapsto f(x, y)$ 的整体可测性! 这一点有时容易被忽略. 相关的问题是: 如果对于几乎所有 $x \in X$, 函数 $y \mapsto f(x, y)$ 在 Y 上非负可测; 同时对于几乎所有 $y \in Y$, 函数 $x \mapsto f(x, y)$ 在 X 上可测, 这时函数 $(x, y) \mapsto f(x, y)$ 一定整体可测吗? 两个特殊情形是

1° 若 $f(x, y)$ 关于一个变量连续, 关于另一个变量可测, 则 $(x, y) \mapsto f(x, y)$ 可测. 这是经典习题, 参见本节作业题1.

2° 若 $f(x), g(y)$ 分别在 X 和 Y 上可测, 则 $(x, y) \mapsto f(x)g(y)$ 可测. 这是下面推论中的结论之一.

【Fubini定理的推论2】 设 $X \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^p), Y \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^q)$.

(a) 设实值或复值函数 $f(x), g(y)$ 分别在 X 和 Y 上可测. 则函数 $(x, y) \mapsto f(x), (x, y) \mapsto g(y)$ 都是 $X \times Y$ 上的可测函数. 因此线性组合 $\alpha f(x) + \beta g(y)$ 和乘积 $f(x)g(y)$ 也都是 $X \times Y$ 上的可测函数.

则函数 $(x, y) \mapsto f(x)g(y)$ 在 $X \times Y$ 上可测. 特别分别取 $f(x) \equiv 1, g(y) \equiv 1$ 知

$$(x, y) \mapsto g(y) \text{ 和 } (x, y) \mapsto f(x) \text{ 都在 } X \times Y \text{ 上可测.}$$

(b) 若 f, g 非负或 $f \in L^1(X), g \in L^1(Y)$, 则

$$\iint_{X \times Y} f(x)g(y)dx dy = \int_X f(x)dx \cdot \int_Y g(y)dy. \quad (2.6.5)$$

特别有

$$m_{p+q}(X \times Y) = m_p(X)m_q(Y). \quad (2.6.6)$$

【证】 首先由命题2.6.2知 $X \times Y \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^{p+q})$.

(a): 先设 f 是实值的. 定义 $F(x, y) = f(x), (x, y) \in X \times Y$. 则对任意 $t \in \mathbb{R}$ 我们有

$$(X \times Y)(F > t) = X(f > t) \times Y.$$

因 $X(f > t) \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^p)$, 故由乘积集合的可测性知 $(X \times Y)(F > t) \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^{p+q})$ 中的可测集. 所以 F 是 $X \times Y$ 上的可测函数, 意即 $(x, y) \mapsto f(x)$ 是 $X \times Y$ 上的可测函数. 当 f 是复值函数时, 将实值的结论用于 f 的实部虚部即知 $(x, y) \mapsto f(x)$ 是 $X \times Y$ 上的可测函数. 同理可证 $(x, y) \mapsto g(y)$ 是 $X \times Y$ 上的可测函数.

(b): 假设 f, g 非负. 则由Fubini 定理有

$$\iint_{X \times Y} f(x)g(y)dx dy = \int_X f(x) \left(\int_Y g(y)dy \right) dx = \left(\int_X f(x)dx \right) \left(\int_Y g(y)dy \right).$$

若 $f \in L^1(X), g \in L^1(Y)$, 则应用上面结果于 $|f(x)|, |g(y)|$ 得

$$\iint_{X \times Y} |f(x)||g(y)|dx dy = \left(\int_X |f(x)|dx \right) \left(\int_Y |g(y)|dy \right) < \infty.$$

所以 $f(x)g(y)$ 在 $X \times Y$ 上 L -可积. 于是由Fubini 定理可知(2.6.5) 成立. 最后由 $\mathbf{1}_{X \times Y}(x, y) = \mathbf{1}_X(x)\mathbf{1}_Y(y)$ 即得(2.6.6). \square

【非乘积型集合上的重积分化累次积分】 下面这个推论告诉我们, 对于一般可测集(特别对于非乘积型的可测集)上的重积分, 怎样把重积分化成累次积分:

【Fubini 定理的推论3】 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $f \in L^1(E)$ 或 f 在 E 上非负可测. 假设 $E \subset X \times Y$ 其中 $X \subset \mathbb{R}^p, Y \subset \mathbb{R}^q$ 为可测集, $p + q = d$. 则有

$$\iint_E f(x, y) dx dy = \int_X \left(\int_Y \mathbf{1}_E(x, y) f(x, y) dy \right) dx = \int_Y \left(\int_X \mathbf{1}_E(x, y) f(x, y) dx \right) dy.$$

利用截口记号和

$$\mathbf{1}_E(x, y) = \mathbf{1}_{E_x}(y) = \mathbf{1}_{E^y}(x)$$

上式也可写成

$$\iint_E f(x, y) dx dy = \int_X \left(\int_{E_x} f(x, y) dy \right) dx = \int_Y \left(\int_{E^y} f(x, y) dx \right) dy.$$

满足 $E \subset X \times Y$ 的集合 X, Y 包括它们的维数, 可以根据 E 的结构和需要任意选取.

【证】 将Fubini 定理应用于 f 的零延拓 $\mathbf{1}_E(x, y)f(x, y), (x, y) \in X \times Y$, 即知所证成立.

□

【例】 设 $d \geq 2, X \subset \mathbb{R}^{d-1}$ 为 L -可测集, $\varphi, \psi : X \rightarrow \mathbb{R}$ 是 L -可测函数(例如 φ, ψ 都在 X 上连续). 令

$$E = \{(x, y) \in \mathbb{R}^d \mid x \in X, \varphi(x) \leq y \leq \psi(x)\}.$$

则 E 是 L -可测集并且当 $f \in L^1(E)$ 或 f 在 E 上非负 L -可测时有

$$\iint_E f(x, y) dx dy = \int_X dx \int_{\varphi(x)}^{\psi(x)} f(x, y) dy.$$

【证】 令 $g(x, y) = \varphi(x) - y, h(x, y) = \psi(x) - y, (x, y) \in X \times \mathbb{R}$, 则由Fubini定理的推论2 (a)知 g, h 都是 $X \times \mathbb{R}$ 上的 L -可测函数. 由 E 的定义易见

$$E = (X \times \mathbb{R})(g \leq 0) \cap (X \times \mathbb{R})(h \geq 0)$$

因此 E 是 L -可测集. 易见

$$\mathbf{1}_E(x, y) = \mathbf{1}_X(x) \mathbf{1}_{\{\varphi(x) \leq y \leq \psi(x)\}} \quad \forall (x, y) \in \mathbb{R}^d$$

特别有

$$\mathbf{1}_E(x, y) = \mathbf{1}_{\{\varphi(x) \leq y \leq \psi(x)\}} \quad \forall (x, y) \in X \times \mathbb{R}.$$

应用Fubini定理即知当 $f \in L^1(E)$ 或 f 在 E 上非负 L -可测时有

$$\begin{aligned} \iint_E f(x, y) dx dy &= \int_{X \times \mathbb{R}} \mathbf{1}_E(x, y) f(x, y) dx dy \\ &= \int_X dx \int_{\mathbb{R}} \mathbf{1}_E(x, y) f(x, y) dy = \int_X dx \int_{\mathbb{R}} \mathbf{1}_{\{\varphi(x) \leq y \leq \psi(x)\}} f(x, y) dy \\ &= \int_X dx \int_{\varphi(x)}^{\psi(x)} f(x, y) dy. \end{aligned}$$

□

【强调】 为了导出各种各样的累次积分, 同学们务必认真学习特征函数的性质并灵活且准确地使用这些性质. 这件事并不难, 但效益巨大! 特征函数的表示举例:

$$\begin{aligned} 0 \leq a < b, p > 0 &\implies \mathbf{1}_{(a, b]}(t) = \mathbf{1}_{\{a < t \leq b\}} = \mathbf{1}_{\{a^p < t^p \leq b^p\}} = \mathbf{1}_{\{a < t\}} \mathbf{1}_{\{t \leq b\}} = \cdots; \\ 0 \leq f(x) \leq b &\implies f(x) = \int_0^{f(x)} dt = \int_0^b \mathbf{1}_{\{0 \leq t \leq f(x)\}} dt = \int_0^b \mathbf{1}_{\{t \leq f(x)\}} dt \end{aligned}$$

最后的等号是因为积分区间 $[0, b] \ni t$ 的限制已经蕴含 $0 \leq t$. 还有

$$m(E(a < f \leq b)) = \int_E \mathbf{1}_{E(a < f \leq b)}(x) dx = \int_E \mathbf{1}_{\{a < f(x) \leq b\}} dx$$

等等.

【例】 再看特征函数的应用. 为了改变累次积分的顺序, 可以先画出整体重积分集合的图形, 然后根据图形确定累次积分的内层积分区间和外层积分区间. 但是当你很难画出图形时(例如积分区域是高维集合), 则唯一可行的办法是使用特征函数. 例如试改变下面累次积分的顺序:

$$I := \int_0^2 dy \int_{y^2}^{3y} f(x, y) dx.$$

这里假定 f 在相应的二重积分区域上非负可测或可积.

【解】 将被积函数作零延拓并使用特征函数, 我们有

$$\begin{aligned} I &= \int_0^2 dy \int_0^\infty \mathbf{1}_{\{y^2 \leq x \leq 3y\}} f(x, y) dx = \int_0^2 dy \int_0^6 \mathbf{1}_{\{y^2 \leq x \leq 3y\}} f(x, y) dx \\ &= \iint_{[0, 6] \times [0, 2]} \{\cdots\} dx dy \quad (\text{然后用Fubini定理保证可换序}) \\ &= \int_0^6 dx \int_0^2 \mathbf{1}_{\{y^2 \leq x \leq 3y\}} f(x, y) dy = \int_0^6 dx \int_0^2 \mathbf{1}_{\{\frac{x}{3} \leq y \leq \sqrt{x}\}} f(x, y) dy \\ &= \int_0^6 dx \int_{\frac{x}{3}}^{\min\{2, \sqrt{x}\}} f(x, y) dy \quad (\text{到此已可以结束}) \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
&= \int_0^4 dx \int_{\frac{x}{3}}^{\min\{2, \sqrt{x}\}} f(x, y) dy + \int_4^6 dx \int_{\frac{x}{3}}^{\min\{2, \sqrt{x}\}} f(x, y) dy \\
&= \int_0^4 dx \int_{\frac{x}{3}}^{\sqrt{x}} f(x, y) dy + \int_4^6 dx \int_{\frac{x}{3}}^2 f(x, y) dy.
\end{aligned}$$

从这个积分顺序不难画出整体积分区域的图形(图示). \square

下面的例题及其证明再次展示特征函数和Fubini 定理的作用.

【例】 设 $E \subset \mathbb{R}^d$ 为 L -可测集, $f : E \rightarrow [0, +\infty)$ 为 L -可测函数, $b \in (0, +\infty)$, 使得 $m(E(f \leq b)) < \infty$ 且函数 $t \mapsto F(t) := m(\mathbb{R}^d(f \leq t))$ 属于 $C^1([0, b])$. 证明: 对任意 $p \in (0, +\infty)$ 有

$$\int_{E(f \leq b)} (f(x))^p dx = \int_0^b t^p F'(t) dt.$$

【证】 首先对任意 $0 \leq s < t \leq b$ 有 $E(f \leq s) \subset E(f \leq t)$ 从而有 $m(E(f \leq s)) \leq m(E(f \leq t)) \leq m(E(f \leq b)) < \infty$, 因此 $F(t)$ 处处有限且单调不减. 同时由

$E(s < f \leq t) = E(f \leq t) \setminus E(f \leq s)$ 有

$$m(E(s < f \leq t)) = m(E(f \leq t)) - m(E(f \leq s)) = F(t) - F(s).$$

下面利用特征函数和Fubini 定理 推导和计算积分:

$$\begin{aligned}
\int_{E(f \leq b)} (f(x))^p dx &= \int_E \mathbf{1}_{\{f(x) \leq b\}} (f(x))^p dx = \int_E \mathbf{1}_{\{f(x) \leq b\}} \left(\int_0^{(f(x))^p} ds \right) dx \\
&= \int_E \mathbf{1}_{\{f(x) \leq b\}} \left(\int_0^{b^p} \mathbf{1}_{\{0 \leq s < (f(x))^p\}} ds \right) dx \\
&= \int_0^{b^p} \left(\int_E \mathbf{1}_{\{f(x) \leq b\}} \mathbf{1}_{\{0 \leq s < (f(x))^p\}} dx \right) ds \quad (\text{by Fubini Theorem}) \\
&= \int_0^{b^p} \left(\int_E \mathbf{1}_{\{0 \leq s^{1/p} < f(x) \leq b\}} dx \right) ds = \int_0^{b^p} \left(\int_E \mathbf{1}_{\{s^{1/p} < f(x) \leq b\}} dx \right) ds \\
&\quad (\text{这是因为外层积分的限制 } s \in [0, b^p] \text{ 已经蕴含 } 0 \leq s^{1/p}) \\
&= \int_0^{b^p} m(E(s^{1/p} < f \leq b)) ds = \int_0^{b^p} (F(b) - F(s^{1/p})) ds \\
&= \int_0^{b^p} \left(\int_{s^{1/p}}^b F'(t) dt \right) ds = \int_0^{b^p} \left(\int_0^b F'(t) \mathbf{1}_{\{s^{1/p} \leq t \leq b\}} dt \right) ds \\
&= \int_0^b F'(t) \left(\int_0^{b^p} \mathbf{1}_{\{s^{1/p} \leq t \leq b\}} ds \right) dt = \int_0^b F'(t) \left(\int_0^{b^p} \mathbf{1}_{\{s \leq t^p\}} ds \right) dt \\
&\quad (\text{这是因为外层积分的限制 } t \in [0, b] \text{ 已经蕴含 } t \leq b) \\
&= \int_0^b F'(t) t^p dt. \quad \square
\end{aligned}$$

【例(分部积分)】 设 \mathbb{R}^d 上的实值或复值函数 f 处处有偏导数 $\frac{\partial f}{\partial x_j}$ 且 $f, \frac{\partial f}{\partial x_j} \in L^1(\mathbb{R}^d)$, 则有

$$\int_{\mathbb{R}^d} \frac{\partial f(x)}{\partial x_j} dx = 0.$$

因此一般地, 设 \mathbb{R}^d 上的实值或复值函数 f, g 处处有偏导数 $\frac{\partial f}{\partial x_j}, \frac{\partial g}{\partial x_j}$ 且 $fg, \frac{\partial f}{\partial x_j}g, f\frac{\partial g}{\partial x_j}$ 皆在 \mathbb{R}^d 上可积, 则成立分部积分:

$$\int_{\mathbb{R}^d} \frac{\partial f(x)}{\partial x_j} g(x) dx = - \int_{\mathbb{R}^d} f(x) \frac{\partial g(x)}{\partial x_j} dx.$$

【证】 我们将使用平移不变性和Fubini 定理. 令 $\mathbf{e}_j \in \mathbb{R}^d$ 为单位向量, 其第 j 个分量为1 其余分量为0. 应用关于非负可测函数的Fubini 定理和平移不变性有

$$\begin{aligned} \int_{\mathbb{R}^d} \left(\int_0^1 \left| \frac{d}{dt}(f(x + t\mathbf{e}_j)) \right| dt \right) dx &= \int_0^1 \int_{\mathbb{R}^d} \left| \frac{d}{dt}(f(x + t\mathbf{e}_j)) \right| dx dt \\ &= \int_0^1 \left(\int_{\mathbb{R}^d} \left| \left(\frac{\partial f}{\partial x_j} \right)(x + t\mathbf{e}_j) \right| dx \right) dt = \int_0^1 \left(\int_{\mathbb{R}^d} \left| \left(\frac{\partial f}{\partial x_j} \right)(x) \right| dx \right) dt \\ &= \int_{\mathbb{R}^d} \left| \frac{\partial f(x)}{\partial x_j} \right| dx < \infty. \end{aligned}$$

据这一整体可积性和部分可积性, 我们可以使用整体可积函数的Fubini 定理和Newton-Lebinitz 公式, 后者是因为从上面整体可积性和Fubini 定理知对几乎所有 $x \in \mathbb{R}^d$, 偏导函数 $t \mapsto \frac{d}{dt}(f(x + t\mathbf{e}_j)) = \left(\frac{\partial f}{\partial x_j} \right)(x + t\mathbf{e}_j)$ 在 $[0, 1]$ 上可积, 从而成立Newton-Lebinitz 公式:

$$f(x + \mathbf{e}_j) - f(x) = \int_0^1 \frac{d}{dt}(f(x + t\mathbf{e}_j)) dt \quad \text{a.e. } x \in \mathbb{R}^d.$$

根据这些和积分的平移不变性有

$$\begin{aligned} 0 &= \int_{\mathbb{R}^d} [f(x + \mathbf{e}_j) - f(x)] dx = \int_{\mathbb{R}^d} \left(\int_0^1 \frac{d}{dt}(f(x + t\mathbf{e}_j)) dt \right) dx \\ &= \int_0^1 \left(\int_{\mathbb{R}^d} \left(\frac{\partial f}{\partial x_j} \right)(x + t\mathbf{e}_j) dx \right) dt = \int_0^1 \left(\int_{\mathbb{R}^d} \frac{\partial f(x)}{\partial x_j} dx \right) dt = \int_{\mathbb{R}^d} \frac{\partial f(x)}{\partial x_j} dx. \end{aligned}$$

对于题目中的一般情形, 据假设易见可将上述结果用于 fg 从而得到

$$0 = \int_{\mathbb{R}^d} \frac{\partial}{\partial x_j}(fg) dx = \int_{\mathbb{R}^d} \frac{\partial f(x)}{\partial x_j} g(x) dx + \int_{\mathbb{R}^d} f(x) \frac{\partial g(x)}{\partial x_j} dx. \quad \square$$

• 函数的卷积(convolution)

Fubini定理的一个重要应用是建立函数的卷积：设 f, g 在 \mathbb{R}^d 上皆非负可测或 $f, g \in L^1(\mathbb{R}^d)$ ，则称

$$(f * g)(x) = \int_{\mathbb{R}^d} f(x-y)g(y)dy, \quad x \in \mathbb{R}^d$$

为函数 f 和 g 的卷积(convolution)。

需要说明定义的合理性：设 f, g 在 \mathbb{R}^d 上可测。则由**Fubini定理的推论2(a)**知 $(x, y) \mapsto f(x)g(y)$ 在 $\mathbb{R}^{2d} = \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d$ 上可测。因线性变换 $(x, y) \rightarrow (x-y, y)$ 可逆，故它保持集合和函数的可测性，因此函数 $(x, y) \mapsto f(x-y)g(y)$ 在 $\mathbb{R}^{2d} = \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d$ 上可测(见上面可测函数例题)。当 f, g 皆非负时，由Fubini定理，函数 $x \mapsto (f * g)(x)$ 在 \mathbb{R}^d 上非负可测且有(重积分化累次积分)

$$\int_{\mathbb{R}^d} (f * g)(x)dx = \int_{\mathbb{R}^d} \left(\int_{\mathbb{R}^d} f(x-y)dx \right) g(y)dy = \left(\int_{\mathbb{R}^d} f(x)dx \right) \left(\int_{\mathbb{R}^d} g(y)dy \right) \quad (2.6.7)$$

这里对内层积分用到了全空间积分的平移不变性：

$$\int_{\mathbb{R}^d} f(x-y)dx = \int_{\mathbb{R}^d} f(x)dx \quad \forall y \in \mathbb{R}^d.$$

当 f, g 不一定非负时，考虑绝对值(!) $|f(x)|, |g(y)|$ ，应用非负情形的上述结果有

$$\iint_{\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d} |f(x-y)||g(y)|dxdy = \left(\int_{\mathbb{R}^d} |f(x)|dx \right) \left(\int_{\mathbb{R}^d} |g(y)|dy \right).$$

由此可见，若 $f, g \in L^1(\mathbb{R}^d)$ ，则

$$\iint_{\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d} |f(x-y)||g(y)|dxdy = \|f\|_{L^1} \|g\|_{L^1} < \infty.$$

这同时说明 $(x, y) \mapsto f(x-y)g(y)$ 在 $\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d$ 上 L -可积，于是应用Fubini定理知函数 $x \mapsto (f * g)(x)$ 在 \mathbb{R}^d 上 L -可积且(2.6.7)成立。此时还有 $|f * g| \leq |f| * |g|$ 从而由上面推导有 $f * g \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 且

$$\|f * g\|_{L^1} \leq \| |f| * |g| \|_{L^1} = \|f\|_{L^1} \|g\|_{L^1}. \quad (2.6.8)$$

根据卷积的定义和积分换元公式(反射加平移) 易见卷积可交换： $f * g = g * f$ ，即

$$(f * g)(x) = (g * f)(x) = \int_{\mathbb{R}^d} f(x-y)g(y)dy = \int_{\mathbb{R}^d} f(y)g(x-y)dy.$$

卷积的意义和作用 —— 卷积是由积分定义的函数，而积分是平均效应，好坏分享，因此卷积后的函数(即由卷积定义的函数) 便具某种连续性或更好的性质，如变得光滑。卷积还有重要的代数性质，这在下面学习Fourier变换时可以看到。

下面用函数的卷积和Fubini 定理研究可测集的线性加(减)法性质.

【集合的线性加法】 设 $A, B \subset \mathbb{R}^d$, $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$. 定义

$$\alpha A + \beta B = \{\alpha x + \beta y \mid x \in A, y \in B\}.$$

我们特别感性趣的是加减法:

$$A + B = \{x + y \mid x \in A, y \in B\}, \quad A - B = \{x - y \mid x \in A, y \in B\}.$$

问题1: 若 A, B 都是 \mathbb{R}^d 中的 Borel 集, 它们的加法 $A + B$ 也是 Borel 集吗? 回答是否定的. 见论文

P. Erdős & A. H. Stone, On the Sum of Two Borel Sets, *Proceedings of the American Mathematical Society*, 1970, 25 (2):304-306.

Abstract: It is shown that the linear sum of two Borel subsets of the real line need not be Borel, even if one of them is compact and the other is G_δ . This result is extended to a fairly wide class of connected topological groups.

问题2: 若 A, B 都是 \mathbb{R}^d 中的 L -可测集, 它们的加法 $A + B$ 也是 L -可测集吗? 至少对偶数维 $d = 2p \geq 2$ 的情形, 回答是否定的[参考周民强《实变函数解题指南》p270 例8(3)]:

首先易见若 $W \subset \mathbb{R}^p$ 不是 L -可测集, 则 $W \times W$ 便不是 \mathbb{R}^{2p} 中的 L -可测集. 否则, 若 $W \times W$ 是 \mathbb{R}^{2p} 中的 L -可测集, 则由 Fubini 定理知存在 $x_0 \in W$ 使得截面 $(W \times W)_{x_0} = \{y \in \mathbb{R}^p \mid (x_0, y) \in W \times W\}$ 是 \mathbb{R}^p 中的 L -可测集. 而显然有 $(W \times W)_{x_0} = W$, 这就得出 W 是 \mathbb{R}^p 中的 L -可测集, 矛盾.

设 $W \subset \mathbb{R}^p$ 不是 L -可测集, $0 \in \mathbb{R}^p$ 中的原点, $A = (W \times \{0\}) \cup (\{0\} \times W)$. 则易见

$$A + A = [(W + W) \times \{0\}] \cup [\{0\} \times (W + W)] \cup (W \times W).$$

上式右边 $(W + W) \times \{0\}$ 和 $\{0\} \times (W + W)$ 都是 \mathbb{R}^{2p} 中的零测集, 而第三个 $W \times W$ 不是 \mathbb{R}^{2p} 中的 L -可测集. 所以 $A + A$ 也不是 \mathbb{R}^{2p} 中的 L -可测集.

问题3: 若 A, B 都是 \mathbb{R}^d 中的零测集, 那么 $A + B$ 也是零测集吗? 回答是否定的. 只需对 $d = 1$ 的情形给出反例. 设 C 是 $[0, 1]$ 中的 Cantor 集, 即

$$C = \left\{ \sum_{k=1}^{\infty} \frac{a_k}{3^k} \mid a_k \in \{0, 2\}, k = 1, 2, 3, \dots \right\}.$$

周知 $m(C) = 0$. 下证 C 与自己的线性加法减法都具有正测度:

$$C + C = [0, 2], \quad C - C = [-1, 1].$$

首先易见 $C + C \subset [0, 2]$. 任取 $x \in [0, 2]$, 可写 $\frac{x}{2} = \sum_{k=1}^{\infty} 3^{-k} c_k, c_k \in \{0, 1, 2\}$. 对任意 $k \in \mathbb{N}$, 若 $c_k \in \{0, 1\}$, 则取 $a_k = 2c_k, b_k = 0$; 若 $c_k = 2$ 则取 $a_k = b_k = 2$. 则有 $a_k, b_k \in \{0, 2\}$ 且 $c_k = \frac{a_k + b_k}{2}, k = 1, 2, 3, \dots$. 因此 $\frac{x}{2} = \frac{1}{2}(\sum_{k=1}^{\infty} 3^{-k} a_k + \sum_{k=1}^{\infty} 3^{-k} b_k)$ 也即 $x = \sum_{k=1}^{\infty} 3^{-k} a_k + \sum_{k=1}^{\infty} 3^{-k} b_k \in C + C$. 因此 $[0, 2] \subset C + C$. 这证明了 $C + C = [0, 2]$. 其次来证明 $C = 1 - C$. 事实上对任意 $x \in [0, 1]$, 写 $x = \sum_{k=1}^{\infty} 3^{-k} c_k, c_k \in \{0, 1, 2\}$, 则由 $1 = 2 \sum_{k=1}^{\infty} 3^{-k}$ 有 $1 - x = \sum_{k=1}^{\infty} 3^{-k} (2 - c_k)$. 易见 $c_k \in \{0, 2\} \iff 2 - c_k \in \{0, 2\}$. 这就证明了 $1 - C = C$. 由此得到(据平移的定义)

$$C - C = (C + 1 - C) - 1 = (C + C) - 1 = [0, 2] - 1 = [-1, 1]. \quad \square$$

虽然有反例, 但一般性的结论是: 若 A, B 都是 \mathbb{R}^d 中的测度 > 0 的 L -可测集, 那么 $A + B$ 包含开球. 特别 $A - A$ 包含一个以0为中心的开球.

【命题2.6.3】 设 $A, B \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 且 $m(A) > 0, m(B) > 0$. 则存在 $x_0 \in \mathbb{R}^d, \delta > 0, r > 0$ 使得 $A + B \supset B(x_0, \delta), A - A \supset B(0, r)$.

【证】 由 $m(A) = \lim_{n \rightarrow \infty} m(A \cap [-n, n]^d), m(B) = \lim_{n \rightarrow \infty} m(B \cap [-n, n]^d)$ 知存在 $N \in \mathbb{N}$ 使得 $m(A \cap [-N, N]^d) > 0, m(B \cap [-N, N]^d) > 0$. 因此只需对 $A \cap [-N, N]^d, B \cap [-N, N]^d$ 证明本命题. 换言之可以进一步假定 A, B 都是测度有限的. 在这一假设下, 特征函数 $\mathbf{1}_A, \mathbf{1}_B$ 都属于 $L^1(\mathbb{R}^d)$. 考虑二者的卷积:

$$(\mathbf{1}_A * \mathbf{1}_B)(x) = \int_{\mathbb{R}^d} \mathbf{1}_A(y) \mathbf{1}_B(x - y) dy, \quad x \in \mathbb{R}^d.$$

先证明 $(\mathbf{1}_A * \mathbf{1}_B)$ 在 \mathbb{R}^d 上连续. 事实上对任意 $x_0 \in \mathbb{R}^d$ 和 $h \in \mathbb{R}^d$ 有

$$\begin{aligned} & \left| (\mathbf{1}_A * \mathbf{1}_B)(x_0 + h) - (\mathbf{1}_A * \mathbf{1}_B)(x_0) \right| = \left| \int_{\mathbb{R}^d} \mathbf{1}_A(y) [\mathbf{1}_B(x_0 + h - y) - \mathbf{1}_B(x_0 - y)] dy \right| \\ & \leq \int_{\mathbb{R}^d} \mathbf{1}_A(y) |\mathbf{1}_B(x_0 + h - y) - \mathbf{1}_B(x_0 - y)| dy \leq \int_{\mathbb{R}^d} |\mathbf{1}_B(x_0 + h - y) - \mathbf{1}_B(x_0 - y)| dy \\ & = \int_{\mathbb{R}^d} |\mathbf{1}_B(y + h) - \mathbf{1}_B(y)| dy \rightarrow 0 \quad \text{as } h \rightarrow 0. \end{aligned}$$

其中趋于零是由于可积函数的平均连续性. 所以 $(\mathbf{1}_A * \mathbf{1}_B)$ 在 \mathbb{R}^d 中每一点连续.

由卷积运算(Fubini定理)和 $m(A) > 0, m(B) > 0$ 有

$$\int_{\mathbb{R}^d} (\mathbf{1}_A * \mathbf{1}_B)(x) dx = \left(\int_{\mathbb{R}^d} \mathbf{1}_A(y) dy \right) \left(\int_{\mathbb{R}^d} \mathbf{1}_B(x) dx \right) = m(A)m(B) > 0.$$

因此存在 $x_0 \in \mathbb{R}^d$ 使得

$$(\mathbf{1}_A * \mathbf{1}_B)(x_0) > 0.$$

于是由连续性, 存在 $\delta > 0$ 使得对任意 $x \in B(x_0, \delta)$ 有 $(\mathbf{1}_A * \mathbf{1}_B)(x) > 0$. 于是对任意 $x \in B(x_0, \delta)$ 有

$$(\mathbf{1}_A * \mathbf{1}_B)(x) = \int_{\mathbb{R}^d} \mathbf{1}_A(y) \mathbf{1}_B(x - y) dy > 0.$$

这蕴含存在 $y \in \mathbb{R}^d$ 使得 $\mathbf{1}_A(y) \mathbf{1}_B(x - y) > 0$, 即 $y \in A, x - y \in B$. 所以 $x = y + x - y \in A + B$. 所以 $B(x_0, \delta) \subset A + B$.

对于 $A - A$ 的情形, 取 $B = -A$ 并取 $x_0 = 0$ 则有

$$(\mathbf{1}_A * \mathbf{1}_{-A})(0) = \int_{\mathbb{R}^d} \mathbf{1}_A(y) \mathbf{1}_{-A}(-y) dy = \int_{\mathbb{R}^d} [\mathbf{1}_A(y)]^2 dy = m(A) > 0.$$

于是上面的结果对于 $B = -A$ 和 $x_0 = 0$ 成立, 即存在 $r > 0$ 使得 $B(0, r) \subset A - A$. \square

下面再用函数的卷积和Fubini 定理研究可积函数的卷积逼近。

【命题2.6.4(卷积逼近)】 设 $K \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 满足 $\int_{\mathbb{R}^d} K(x) dx = 1$. 令

$$K_\delta(x) = \delta^{-d} K(\delta^{-1}x), \quad x \in \mathbb{R}^d, \quad \delta > 0.$$

则对任意 $f \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 有

$$\lim_{\delta \rightarrow 0+} \|K_\delta * f - f\|_{L^1} = 0.$$

【证】 设 $f \in L^1(\mathbb{R}^d)$. 由展缩变换和 $\int_{\mathbb{R}^d} K(y) dy = 1$ 有

$$\begin{aligned} (K_\delta * f)(x) - f(x) &= \int_{\mathbb{R}^d} K_\delta(y) f(x - y) dy - f(x) \\ &= \int_{\mathbb{R}^d} K(y) f(x - \delta y) dy - f(x) \int_{\mathbb{R}^d} K(y) dy = \int_{\mathbb{R}^d} K(y) [f(x - \delta y) - f(x)] dy \\ \implies |(K_\delta * f)(x) - f(x)| &\leq \int_{\mathbb{R}^d} |K(y)| |f(x - \delta y) - f(x)| dy \\ \implies \|K_\delta * f - f\|_{L^1} &= \int_{\mathbb{R}^d} \left(\int_{\mathbb{R}^d} |K(y)| |f(x - \delta y) - f(x)| dy \right) dx \\ &= \int_{\mathbb{R}^d} |K(y)| \left(\int_{\mathbb{R}^d} |f(x - \delta y) - f(x)| dx \right) dy =: \int_{\mathbb{R}^d} |K(y)| \omega_f(\delta y) dy \end{aligned}$$

其中

$$\omega_f(h) = \int_{\mathbb{R}^d} |f(x-h) - f(x)| dx, \quad h \in \mathbb{R}^d.$$

由 $f \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 和可积函数的平均连续性有

$$\lim_{\delta \rightarrow 0+} \omega_f(\delta y) = 0 \quad \forall y \in \mathbb{R}^d; \quad 0 \leq \omega_f(\delta y) \leq 2\|f\|_{L^1} \quad \forall y \in \mathbb{R}^d, \forall \delta > 0$$

$$\implies \lim_{\delta \rightarrow 0+} |K(y)|\omega_f(\delta y) = 0, \quad 0 \leq |K(y)|\omega_f(\delta y) \leq 2\|f\|_{L^1}|K(y)| \quad \forall y \in \mathbb{R}^d, \forall \delta > 0.$$

于是对函数族 $\{|K(y)|\omega_f(\delta y)\}_{\delta>0}$ 可以应用连续参量的Lebesgue 控制收敛定理, 从而有

$$\lim_{\delta \rightarrow 0+} \|K_\delta * f - f\|_{L^1} = \lim_{\delta \rightarrow 0+} \int_{\mathbb{R}^d} |K(y)|\omega_f(\delta y) dy = \int_{\mathbb{R}^d} 0 dx = 0. \quad \square$$

【再讲Fubini 定理的一个经典应用】 在第一章学习Vitali覆盖引理的应用时, 我们证明了 \mathbb{R}^d 中的任一非空开集可以几乎被可数多个互不相交的闭球覆盖, 即: 若 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为一非空开集, 则存在一系列互不相交的闭球 $B_k \subset \Omega, k = 1, 2, 3, \dots$, 使得 $m(\Omega \setminus \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k) = 0$. 现在对这列闭球 B_k , 应用Fubini 定理我们来证明, 若 $d \geq 2$, 则对每个 $p \in \{1, 2, \dots, d-1\}$ 都有

$$\sum_{k=1}^{\infty} (\text{diam}(B_k))^p = \infty.$$

我们把证明分为两个一般性的例题:

【例1】 设 $p, q \in \mathbb{N}, \mathbb{R}^{p+q} = \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q$. 则有:

(1) 若 $E \subset \mathbb{R}^{p+q}$ 分别是 \mathbb{R}^{p+q} 中的开集/闭集/紧集, 则对任意 $x \in \mathbb{R}^p$, 截口

$$E_x = \{y \in \mathbb{R}^q \mid (x, y) \in E\}$$

分别是 \mathbb{R}^q 中的开集/闭集/紧集. [注: 根据规定, 空集同时是开集、闭集、紧集.]

(2) 设 $K \subset \mathbb{R}^{p+q}$ 为非空紧集, $D \subset \mathbb{R}^p$ 是 K 向 \mathbb{R}^p 的投影, 即

$$D = \{x \in \mathbb{R}^p \mid \exists y \in \mathbb{R}^q \text{ s.t. } (x, y) \in K\}.$$

则 D 是紧集且

$$m_p(D) \leq C_p (\text{diam}(K))^p$$

其中 $C_p = m_p(\mathbb{B}^p)$, $\mathbb{B}^p = \{x \in \mathbb{R}^p \mid |x| \leq 1\}$ (单位球), m_p 是 \mathbb{R}^p 上的Lebesgue 测度.

【证】(1): 设 E 是 \mathbb{R}^{p+q} 中的开集. 任取 $x \in \mathbb{R}^p$. 可设 $E_x \neq \emptyset$. 对任意 $y \in E_x$, 由 $(x, y) \in E$ 和 E 开可知存在 $\delta > 0$ 使得 $B_{p+q}((x, y), \delta) \subset E$. 于是当 $z \in B_q(y, \delta)$ 时有 $|(x, z) - (x, y)| = |z - y| < \delta$ 即 $(x, z) \in B_{p+q}((x, y), \delta)$. 因此 $(x, z) \in E$ 即 $z \in E_x$. 这证明了 $B_q(y, \delta) \subset E_x$. 所以 E_x 是开集. 其余两个的证明也是简单的.

(2): 先证明 D 是紧集(从而是可测集). 任取序列 $\{x_n\}_{n=1}^\infty \subset D$. 则由 D 的定义知存在 $y_n \in \mathbb{R}^q$ 使得 $(x_n, y_n) \in K, n = 1, 2, 3, \dots$. 因 K 是紧集, 故存在子列 $\{(x_{n_j}, y_{n_j})\}_{j=1}^\infty$ 和 $(x_*, y_*) \in K$ 使得 $(x_{n_j}, y_{n_j}) \rightarrow (x_*, y_*) (j \rightarrow \infty)$. 这蕴含 $x_* \in D$ 且 $\lim_{j \rightarrow \infty} x_{n_j} = x_*$. 这表明 D 中的每个序列都有在 D 中收敛的子列. 所以 D 是紧集.

取 $(x_0, y_0) \in K$. 则对任意 $x \in D$ 存在 $y \in \mathbb{R}^q$ 使得 $(x, y) \in K$ 从而有 $|x - x_0| \leq \sqrt{|x - x_0|^2 + |y - y_0|^2} = |(x, y) - (x_0, y_0)| \leq \text{diam}(K)$. 这表明 $x \in \overline{B}(x_0, \text{diam}(K))$. 所以 $D \subset \overline{B}(x_0, \text{diam}(K))$. 于是得到

$$m_p(D) \leq m_p(\overline{B}(x_0, \text{diam}(K))) = C_p(\text{diam}(K))^p.$$

最后的等号用到可测集的平移展缩的测度计算公式和 $C_p = m_p(\mathbb{B}^p)$:

$$\overline{B}(x_0, r) = x_0 + r\mathbb{B}^p \implies m_p(\overline{B}(x_0, r)) = r^p m_p(\mathbb{B}^p). \quad \square$$

【例2】设 $d \geq 2, \Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为非空开集, $K_j \subset \Omega$ 为非空紧集, $j = 1, 2, 3, \dots$. 则有下列蕴含关系: 若

$$m\left(\Omega \setminus \bigcup_{j=1}^\infty K_j\right) = 0$$

则对每个 $p \in \{1, 2, \dots, d-1\}$ 都有

$$\sum_{j=1}^\infty (\text{diam}(K_j))^p = \infty.$$

等价地, 若存在 $p \in \{1, 2, \dots, d-1\}$ 使得

$$\sum_{j=1}^\infty (\text{diam}(K_j))^p < \infty$$

则必有

$$m\left(\Omega \setminus \bigcup_{j=1}^\infty K_j\right) > 0.$$

【证】[参考周民强《实变函数解题指南》p270 例8(2)] 等价地只需证明第二个蕴含关系: 假设存在 $p \in \{1, 2, \dots, d-1\}$ 使得 $\sum_{j=1}^\infty (\text{diam}(K_j))^p < \infty$, 来证明 $m(\Omega \setminus \bigcup_{j=1}^\infty K_j) > 0$

0. 考虑分解 $\mathbb{R}^d = \mathbb{R}^p \times \mathbb{R}^q$ 其中 $q = d - p$. 设 $D_j \subset \mathbb{R}^p$ 是 K_j 向 \mathbb{R}^p 的投影, 即

$$D_j = \{x \in \mathbb{R}^p \mid \exists y \in \mathbb{R}^q \text{ s.t. } (x, y) \in K_j\}.$$

由上面例题和假设 $\sum_{j=1}^{\infty} (\text{diam}(K_j))^p < \infty$ 知 D_j 是紧集且

$$\sum_{j=1}^{\infty} m_p(D_j) \leq C_p \sum_{j=1}^{\infty} (\text{diam}(K_j))^p < \infty.$$

这里 m_p 是 \mathbb{R}^p 上的 Lebesgue 测度. 令

$$Z = \bigcap_{i=1}^{\infty} \bigcup_{j=i}^{\infty} D_j.$$

则 $m_p(Z) = 0$. 设 $\Omega_x = \{y \in \mathbb{R}^q \mid (x, y) \in \Omega\}$ 是 Ω 在 x 的截面. 则由 Ω 是开集知 Ω_x 是 \mathbb{R}^q 中的开集. 令

$$E = \{x \in \mathbb{R}^p \mid m_q(\Omega_x) > 0\}.$$

则由 Ω 是 \mathbb{R}^d 中的非空开集和 Fubini 定理知 $x \mapsto m_q(\Omega_x)$ 是 \mathbb{R}^p 上的 L -可测函数从而 E 是 \mathbb{R}^p 中的 L -可测集且

$$0 < m_d(\Omega) = \int_{\mathbb{R}^p} m_q(\Omega_x) dx = \int_E m_q(\Omega_x) dx.$$

这蕴含 $m_p(E) > 0$. 于是有 $m_p(E \setminus Z) = m_p(E) > 0$. 再看测度: 由 Fubini 定理和截面运算有

$$\begin{aligned} m_d\left(\Omega \setminus \bigcup_{j=1}^{\infty} K_j\right) &= \int_{\mathbb{R}^p} m_q\left(\left(\Omega \setminus \bigcup_{j=1}^{\infty} K_j\right)_x\right) dx = \int_{\mathbb{R}^p} m_q\left(\Omega_x \setminus \bigcup_{j=1}^{\infty} (K_j)_x\right) dx \\ &= \int_E m_q\left(\Omega_x \setminus \bigcup_{j=1}^{\infty} (K_j)_x\right) dx = \int_{E \setminus Z} m_q\left(\Omega_x \setminus \bigcup_{j=1}^{\infty} (K_j)_x\right) dx. \end{aligned}$$

来证明

$$\text{对每个 } x \in E \setminus Z, \text{ 集合 } \Omega_x \setminus \bigcup_{j=1}^{\infty} (K_j)_x \text{ 都是 } \mathbb{R}^q \text{ 的非空开集.} \quad (*)$$

任取 $x \in E \setminus Z$. 由 Z 的定义知存在 $i_x \in \mathbb{N}$ 使得 $x \notin \bigcup_{j=i_x}^{\infty} D_j$. 而由 K_j 的投影 D_j 的定义知: 若 $(K_j)_x \neq \emptyset$, 则 $x \in D_j$; 因此若 $x \notin D_j$ 则必有 $(K_j)_x = \emptyset$. 于是可知当 $j \geq i_x$ 时 $(K_j)_x = \emptyset$ 从而有

$$\bigcup_{j=1}^{\infty} (K_j)_x = \bigcup_{j=1}^{i_x} (K_j)_x, \quad \Omega_x \setminus \bigcup_{j=1}^{\infty} (K_j)_x = \Omega_x \setminus \bigcup_{j=1}^{i_x} (K_j)_x.$$

由此易知(*)成立. 事实上由 K_j 是紧集知其截面 $(K_j)_x$ 也是紧集从而 $\bigcup_{j=1}^{i_x}(K_j)_x$ 是紧集, 因此上式右边 $\Omega_x \setminus \bigcup_{j=1}^{i_x}(K_j)_x$ 是开集. 假若它是空集, 则导致 $\Omega_x \subset \bigcup_{j=1}^{i_x}(K_j)_x$. 但由 $K_j \subset \Omega$ 又有 $(K_j)_x \subset \Omega_x$ 从而得到 $\Omega_x = \bigcup_{j=1}^{i_x}(K_j)_x$. 这蕴含 Ω_x 既开又闭从而是全空间: $\Omega_x = \mathbb{R}^q$. 但这不可能, 因为 $\bigcup_{j=1}^{i_x}(K_j)_x$ 是紧集. 这个矛盾证明了(*)成立.

由(*) 便有

$$m_q\left(\Omega_x \setminus \bigcup_{j=1}^{\infty}(K_j)_x\right) > 0 \quad \forall x \in E \setminus Z.$$

再由 $m_p(E \setminus Z) > 0$ 即得

$$m_d\left(\Omega \setminus \bigcup_{j=1}^{\infty} K_j\right) = \int_{E \setminus Z} m_q\left(\Omega_x \setminus \bigcup_{j=1}^{\infty}(K_j)_x\right) dx > 0.$$

□

§2.7. L^1 -函数的Fourier 变换和Fourier反演公式

Fourier 变换是一种积分变换, 是研究函数分析性质的最常用最有力的工具之一, 在函数空间、微分方程、信号/图像处理、概率论等研究中有广泛应用。我们在后面学习Hilbert 空间特别是 L^2 空间时会系统学习关于Fourier 变换的基本性质。这里, 作为Fubini 定理和已学过其他定理的应用, 我们先学习 L^1 -函数的Fourier 变换和Fourier 反演公式。

【 $L^1(\mathbb{R}^d)$ 上的Fourier 变换】设 $f \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 为实值或复值函数, 则称

$$\widehat{f}(\xi) = \int_{\mathbb{R}^d} f(x) e^{-2\pi i x \cdot \xi} dx, \quad \xi \in \mathbb{R}^d \quad (2.7.1)$$

为 f 的Fourier 变换, 这里 $x \cdot \xi = \langle x, \xi \rangle$ 为向量内积。 \square

如果还有 $\widehat{f} \in L^1(\mathbb{R}^d)$, 则对 $\widehat{f}(-\xi)$ 再取Fourier 变换可重新得到 f , 即

$$f(x) = \int_{\mathbb{R}^d} \widehat{f}(-\xi) e^{-2\pi i x \cdot \xi} d\xi, \quad x \in \mathbb{R}^d$$

即

$$f(x) = \int_{\mathbb{R}^d} \widehat{f}(\xi) e^{2\pi i x \cdot \xi} d\xi, \quad x \in \mathbb{R}^d. \quad (2.7.2)$$

公式(2.7.2)称为**Fourier 反演公式**, 即Fourier 变换(2.7.1)的逆变换公式。

需说明: 从下面的命题知, L^1 -可积函数的Fourier 变换是连续函数, 因此(2.7.2)蕴含 f 在 \mathbb{R}^d 上连续, 然而在一个零测集上修改函数值不影响可积性和积分, 故一般来说(2.7.2)应是几乎处处成立。在证明反演公式前, 先学习 L^1 -函数的Fourier 变换的基本性质。

【**命题2.7.1**】设 $f, g \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 并设 $\alpha, \beta \in \mathbb{C}$, $\lambda > 0$ 和 $h \in \mathbb{R}^d$ 为常量. 则有

(a) L^1 上的Fourier 变换的正则性(连续、有界、衰减):

$$\widehat{f} \in C(\mathbb{R}^d), \quad \|\widehat{f}\|_{L^\infty} \leq \|f\|_{L^1}, \quad \text{and} \quad \lim_{|\xi| \rightarrow \infty} \widehat{f}(\xi) = 0.$$

(b) Fourier 变换是线性的:

$$(\alpha f + \beta g)\widehat{(\cdot)}(\xi) = \alpha \widehat{f}(\xi) + \beta \widehat{g}(\xi), \quad \xi \in \mathbb{R}^d.$$

(c) 平移和展缩的Fourier 变换:

$$\lambda^{-d} \widehat{f\left(\frac{\cdot + h}{\lambda}\right)}(\xi) = e^{2\pi i \xi \cdot h} \widehat{f}(\lambda \xi), \quad \lambda^{-d} \widehat{f\left(\frac{\xi + h}{\lambda}\right)} = \widehat{f(\lambda \cdot)}(\xi + h).$$

(d) Fourier 变换把卷积变成普通乘积:

$$\widehat{f * g}(\xi) = \widehat{f}(\xi)\widehat{g}(\xi), \quad \xi \in \mathbb{R}^d.$$

(e) 乘法公式:

$$\int_{\mathbb{R}^d} \widehat{f}(\xi)g(\xi)d\xi = \int_{\mathbb{R}^d} f(x)\widehat{g}(x)dx.$$

(f) 偏导数关系: 假设 $f(x)(1+|x|)$ 在 \mathbb{R}^d 上可积, 则有

$$\frac{\partial}{\partial \xi_j} \widehat{f}(\xi) = -2\pi i \widehat{x_j f}(\xi), \quad \xi \in \mathbb{R}^d, \quad j = 1, 2, \dots, d.$$

其中 ξ_j, x_j 分别是 $\xi = (\xi_1, \xi_2, \dots, \xi_d), x = (x_1, x_2, \dots, x_d)$ 的第 j 个分量.

又若 f 在 \mathbb{R}^d 上处处有各一阶偏导且 $f, \frac{\partial f}{\partial x_j} \in L^1(\mathbb{R}^d)$ ($j = 1, 2, \dots, d$), 则有

$$\frac{\partial \widehat{f}}{\partial x_j}(\xi) = 2\pi i \xi_j \widehat{f}(\xi), \quad \xi \in \mathbb{R}^d, \quad j = 1, 2, \dots, d.$$

【证】(a): 先证有界性, 它是显然的: 由 $|e^{i\theta}| \equiv 1, \theta \in \mathbb{R}$ 有

$$|\widehat{f}(\xi)| \leq \int_{\mathbb{R}^d} |f(x)e^{-2\pi i x \cdot \xi}| dx = \int_{\mathbb{R}^d} |f(x)| dx = \|f\|_{L^1}, \quad \xi \in \mathbb{R}^d.$$

证连续性: 对任意 $\xi, h \in \mathbb{R}^d$ 有

$$\begin{aligned} & |e^{-2\pi i x \cdot (\xi+h)} - e^{-2\pi i x \cdot \xi}| = |e^{-2\pi i x \cdot \xi}(e^{-2\pi i x \cdot h} - 1)| = |e^{-2\pi i x \cdot h} - 1| \\ \Rightarrow & |\widehat{f}(\xi+h) - \widehat{f}(\xi)| = \left| \int_{\mathbb{R}^d} f(x)(e^{-2\pi i x \cdot (\xi+h)} - e^{-2\pi i x \cdot \xi}) dx \right| \\ & \leq \int_{\mathbb{R}^d} |f(x)| |e^{-2\pi i x \cdot (\xi+h)} - e^{-2\pi i x \cdot \xi}| dx = \int_{\mathbb{R}^d} |f(x)| |e^{-2\pi i x \cdot h} - 1| dx \\ \Rightarrow & \sup_{\xi \in \mathbb{R}^d} |\widehat{f}(\xi+h) - \widehat{f}(\xi)| \leq \int_{\mathbb{R}^d} |f(x)| |e^{-2\pi i x \cdot h} - 1| dx, \quad h \in \mathbb{R}^d. \end{aligned}$$

因

$$\lim_{h \rightarrow 0} |f(x)| |e^{-2\pi i x \cdot h} - 1| = 0, \quad |f(x)| |e^{-2\pi i x \cdot h} - 1| \leq 2|f(x)| \quad \forall x \in \mathbb{R}^d$$

故由连续参量的Lebesgue控制收敛定理知

$$\lim_{h \rightarrow 0} \int_{\mathbb{R}^d} |f(x)| |e^{-2\pi i x \cdot h} - 1| dx = 0. \quad \text{所以} \quad \lim_{h \rightarrow 0} \sup_{\xi \in \mathbb{R}^d} |\widehat{f}(\xi+h) - \widehat{f}(\xi)| = 0.$$

这实际上证明了 \widehat{f} 在 \mathbb{R}^d 上一致连续.

衰减: 对任意 $\xi \in \mathbb{R}^d \setminus \{0\}$, 令 $h = \frac{\xi}{2|\xi|^2}$, 则有 $h \cdot \xi = \frac{1}{2}$, 从而有

$$e^{-2\pi i (x+h) \cdot \xi} = e^{-2\pi i x \cdot \xi} e^{-2\pi i h \cdot \xi} = e^{-2\pi i x \cdot \xi} e^{-\pi i} = -e^{-2\pi i x \cdot \xi}.$$

于是由平移公式有

$$\begin{aligned}\widehat{f}(\xi) &= \int_{\mathbb{R}^d} f(x+h)e^{-2\pi i(x+h)\cdot\xi} dx = - \int_{\mathbb{R}^d} f(x+h)e^{-2\pi i x\cdot\xi} dx \\ &= \frac{1}{2} \int_{\mathbb{R}^d} (f(x) - f(x+h))e^{-2\pi i x\cdot\xi} dx\end{aligned}$$

然后由可积函数的平均连续性和 $h = \frac{\xi}{2|\xi|^2} \rightarrow 0$ 当 $|\xi| \rightarrow \infty$ 即得

$$|\widehat{f}(\xi)| \leq \frac{1}{2} \int_{\mathbb{R}^d} |f(x) - f(x+h)| dx \rightarrow 0 \quad \text{as } |\xi| \rightarrow \infty.$$

(b): 线性质是显然的.

(c): 由积分的平移和展缩变换有

$$\begin{aligned}\lambda^{-d} \widehat{f\left(\frac{\cdot+h}{\lambda}\right)}(\xi) &= \lambda^{-d} \int_{\mathbb{R}^d} f\left(\frac{x+h}{\lambda}\right) e^{-2\pi i \xi \cdot x} dx = \int_{\mathbb{R}^d} f(y) e^{-2\pi i \xi \cdot (\lambda y - h)} dy \\ &= e^{2\pi i \xi \cdot h} \int_{\mathbb{R}^d} f(y) e^{-2\pi i \lambda \xi \cdot y} dy = e^{2\pi i \xi \cdot h} \widehat{f}(\lambda \xi),\end{aligned}$$

$$\lambda^{-d} \widehat{f\left(\frac{\xi+h}{\lambda}\right)} = \lambda^{-d} \int_{\mathbb{R}^d} f(x) e^{-2\pi i \frac{\xi+h}{\lambda} \cdot x} dx = \int_{\mathbb{R}^d} f(\lambda y) e^{-2\pi i (\xi+h) \cdot y} dy = \widehat{f(\lambda \cdot)}(\xi+h).$$

(d): 由 L^1 -函数的卷积性质知 $f * g \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 因此其Fourier 变换 $\widehat{f * g}(\xi)$ 有定义. 易见对任意 $\xi \in \mathbb{R}^d$ 函数 $(x, y) \mapsto f(x-y)g(y)e^{-2\pi i \xi \cdot x}$ 属于 $L^1(\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d)$, 因此由Fubini 定理知下面推导成立:

$$\begin{aligned}\widehat{f * g}(\xi) &= \iint_{\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d} f(x-y)g(y)e^{-2\pi i \xi \cdot x} dy dx = \iint_{\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d} f(x)g(y)e^{-2\pi i \xi \cdot (x+y)} dy dx \\ &= \iint_{\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d} f(x)e^{-2\pi i \xi \cdot x} g(y)e^{-2\pi i \xi \cdot y} dy dx \\ &= \left(\int_{\mathbb{R}^d} f(x)e^{-2\pi i \xi \cdot x} dx \right) \left(\int_{\mathbb{R}^d} g(y)e^{-2\pi i \xi \cdot y} dy \right) = \widehat{f}(\xi)\widehat{g}(\xi).\end{aligned}$$

(e): 由 $f, g \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 知函数 $(x, \xi) \mapsto f(x)e^{-2\pi i \xi \cdot x}g(\xi)$ 属于 $L^1(\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d)$, 因此由Fubini 定理, 下面推导成立:

$$\begin{aligned}\int_{\mathbb{R}^d} \widehat{f}(\xi)g(\xi)d\xi &= \iint_{\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d} f(x)e^{-2\pi i \xi \cdot x}g(\xi)dx d\xi = \int_{\mathbb{R}^d} f(x) \left(\int_{\mathbb{R}^d} g(\xi)e^{-2\pi i x \cdot \xi} d\xi \right) dx \\ &= \int_{\mathbb{R}^d} f(x)\widehat{g}(x)dx.\end{aligned}$$

(f): 设 $f(x)(1+|x|)$ 在 \mathbb{R}^d 上可积. 下面等式的右边

$$\left| \frac{\partial}{\partial \xi_j} f(x)e^{-2\pi i \langle \xi, x \rangle} \right| = 2\pi |x_j f(x)| \quad (\forall x, \xi \in \mathbb{R}^d)$$

在 \mathbb{R}^d 上可积. 因此应用积分号下求导定理, 对每个 $j \in \{1, 2, \dots, d\}$ 有

$$\frac{\partial}{\partial \xi_j} \widehat{f}(\xi) = \int_{\mathbb{R}^d} \frac{\partial}{\partial \xi_j} f(x) e^{-2\pi i \xi \cdot x} dx = -2\pi i \int_{\mathbb{R}^d} x_j f(x) e^{-2\pi i \xi \cdot x} dx = -2\pi i \widehat{x_j f(x)}(\xi).$$

其次设 f 在 \mathbb{R}^d 上处处有各一阶偏导且 $f, \frac{\partial f}{\partial x_j} \in L^1(\mathbb{R}^d)$ ($j \in \{1, 2, \dots, d\}$), 则在上面的例(分部积分)中取 $g(x) = e^{-2\pi i \xi \cdot x}$ (ξ 固定) 易见 f, g 满足分部积分公式的条件, 从而有

$$\frac{\partial \widehat{f}}{\partial x_j}(\xi) = \int_{\mathbb{R}^d} \left(\frac{\partial}{\partial x_j} f(x) \right) e^{-2\pi i \xi \cdot x} dx = 2\pi i \xi_j \int_{\mathbb{R}^d} f(x) e^{-2\pi i \xi \cdot x} dx = 2\pi i \xi_j \widehat{f}(\xi).$$

□

【Gauss 函数】 Gauss 函数 $G(x), G_\delta(x)$ 在Fourier分析和概率论中有广泛应用:

$$G(x) = e^{-\pi|x|^2}, \quad G_\delta(x) = \delta^{-d} G\left(\frac{x}{\delta}\right) = \delta^{-d} e^{-\pi|x|^2/\delta^2}, \quad x \in \mathbb{R}^d, \delta > 0.$$

下面命题及其证明中的结果刻画了Gauss函数.

【命题2.7.3】 我们有

$$\widehat{G}(\xi) = G(\xi) = e^{-\pi|\xi|^2}, \quad \xi \in \mathbb{R}^d.$$

一般有

$$\widehat{G_\delta}(\xi) = G(\delta\xi) = e^{-\pi\delta^2|\xi|^2}, \quad \xi \in \mathbb{R}^d, \delta > 0.$$

【证】 先设 $d = 1$. 此时我们证明 $\widehat{G}(\xi)$ 满足微分方程

$$(\widehat{G})'(\xi) + 2\pi\xi\widehat{G}(\xi) = 0, \quad \xi \in \mathbb{R}; \quad \widehat{G}(0) = 1. \quad (2.7.3)$$

首先由展缩变换和一维的结果有

$$\int_{\mathbb{R}} G_\delta(x) dx = \delta^{-1} \int_{\mathbb{R}} e^{-\pi x^2/\delta^2} dx = \delta^{-1} \frac{\delta}{\sqrt{\pi}} \int_{\mathbb{R}} e^{-x^2} dx = \frac{1}{\sqrt{\pi}} \sqrt{\pi} = 1.$$

取 $\delta = 1$ 得到

$$\widehat{G}(0) = \int_{\mathbb{R}} G(x) dx = 1.$$

其次证明 $G(x)(1 + |x|)$ 在 \mathbb{R} 上可积. 由

$$\lim_{|x| \rightarrow \infty} \frac{1 + |x|}{e^{\frac{\pi}{2}x^2}} = 0$$

知存在 $0 < C < \infty$ 使得 $1 + |x| \leq Ce^{\frac{\pi}{2}x^2}$ for all $x \in \mathbb{R}$. 因此

$$G(x)(1 + |x|) \leq CG(x)e^{\frac{\pi}{2}x^2} = Ce^{-\frac{\pi}{2}x^2} \quad \forall x \in \mathbb{R}.$$

这蕴含 $G(x)(1+|x|)$ 在 \mathbb{R} 上可积. 因此据 **命题2.7.1(f)** 知

$$\widehat{G}'(\xi) = -2\pi i \xi \widehat{G}(\xi), \quad \xi \in \mathbb{R}.$$

而由上面的**例(分部积分)**或直接计算有

$$\begin{aligned} \widehat{xG}(\xi) &= \int_{-\infty}^{\infty} x e^{-\pi x^2} e^{-2\pi i \xi x} dx \\ &= \frac{e^{-\pi x^2}}{-2\pi} e^{-2\pi i \xi x} \Big|_{x=-\infty}^{x=\infty} + \frac{1}{2\pi} \int_{-\infty}^{\infty} e^{-\pi x^2} e^{-2\pi i \xi x} (-2\pi i \xi) dx \\ &= -i\xi \int_{-\infty}^{\infty} e^{-\pi x^2} e^{-2\pi i \xi x} dx = -i\xi \widehat{G}(\xi). \end{aligned}$$

代入上式即得

$$\widehat{G}'(\xi) = -2\pi i (-i\xi) \widehat{G}(\xi) = -2\pi \xi \widehat{G}(\xi), \quad \xi \in \mathbb{R}.$$

所以 $\widehat{G}(\xi)$ 满足微分方程(2.7.3). 由这一方程得到

$$\frac{d}{d\xi} \left(\widehat{G}(\xi) e^{\pi \xi^2} \right) = 0, \quad \xi \in \mathbb{R}.$$

因此

$$\widehat{G}(\xi) e^{\pi \xi^2} = \text{常数} = \widehat{G}(0) = 1, \quad \xi \in \mathbb{R}$$

所以 $\widehat{G}(\xi) = e^{-\pi \xi^2} = G(\xi)$ for all $\xi \in \mathbb{R}$. 由这一结果和Fourier变换的展缩变换可得

$$\widehat{G_\delta}(\xi) = \widehat{G}(\delta \xi) = G(\delta \xi) = e^{-\pi \delta^2 \xi^2}.$$

对于 $d \geq 2$, 应用这一结果和 $G_\delta(x_1, x_2, \dots, x_d)$ 的乘积结构以及Fubini 定理便有

$$\begin{aligned} \widehat{G_\delta}(\xi) &= \delta^{-d} \int_{\mathbb{R}^d} e^{-\pi |x|^2 / \delta^2} e^{-2\pi i \xi \cdot x} dx = \delta^{-d} \int_{\mathbb{R}^d} \left(\prod_{j=1}^d e^{-\pi x_j^2 / \delta^2} e^{-2\pi i \xi_j x_j} \right) dx_1 dx_2 \cdots dx_d \\ &= \prod_{j=1}^d \delta^{-1} \int_{\mathbb{R}} e^{-\pi x_j^2 / \delta^2} e^{-2\pi i \xi_j x_j} dx_j = \prod_{j=1}^d e^{-\pi \delta^2 \xi_j^2} = e^{-\pi \delta^2 |\xi|^2}, \quad \xi \in \mathbb{R}^d. \quad \square \end{aligned}$$

【命题2.7.4(Fourier 反演公式)】 若 $f, \widehat{f} \in L^1(\mathbb{R}^d)$, 则反演公式(2.7.2) 几乎处处成立:

$$f(x) = \int_{\mathbb{R}^d} \widehat{f}(\xi) e^{2\pi i x \cdot \xi} d\xi \quad \text{a.e. } x \in \mathbb{R}^d.$$

【证】 设 $f, \widehat{f} \in L^1(\mathbb{R}^d)$, 考虑卷积逼近。对于Gauss 函数 $G(x) = e^{-\pi |x|^2}$, 上面已证明 $\int_{\mathbb{R}^d} G(x) dx = 1$, 故在**命题2.6.4(卷积逼近)**中可以取 $K(x) = G(x)$ 从而有

$$\|G_\delta * f - f\|_{L^1} \rightarrow 0 \quad \text{as } \delta \rightarrow 0+.$$

取 $\delta = \frac{1}{n}, n = 1, 2, 3, \dots$, 则有 $\|G_{\frac{1}{n}} * f - f\|_{L^1} \rightarrow 0 (n \rightarrow \infty)$. 因此存在子列 $\{\delta_k = \frac{1}{n_k}\}_{k=1}^{\infty}$ 使得

$$\lim_{k \rightarrow \infty} (G_{\delta_k} * f)(x) = f(x) \quad \text{a.e. } x \in \mathbb{R}^d. \quad (2.7.4)$$

这里用到事实: 序列按 L^1 范数收敛蕴含依测度收敛从而蕴含存在子列几乎处处收敛, 见**定理2.2.11**证明后面的[注2]. 其次来证明

$$(G_{\delta} * f)(x) = \int_{\mathbb{R}^d} e^{-\pi\delta^2|\xi|^2} \widehat{f}(\xi) e^{2\pi i \xi \cdot x} d\xi, \quad x \in \mathbb{R}^d. \quad (2.7.5)$$

事实上由 $G_{\delta}(x)$ 是偶函数、 $G_{\delta}(x)$ 与 $G(x)$ 的关系、 $G(\xi) = \widehat{G}(\xi)$ 和**命题2.7.1(c)**有

$$G_{\delta}(x - y) = G_{\delta}(y - x) = \delta^{-d} G\left(\frac{y - x}{\delta}\right) = \delta^{-d} \widehat{G}\left(\frac{y - x}{\delta}\right) = \widehat{G(\delta \cdot)}(y - x), \quad x, y \in \mathbb{R}^d.$$

由此和乘法公式得到

$$\begin{aligned} (G_{\delta} * f)(x) &= \int_{\mathbb{R}^d} G_{\delta}(x - y) f(y) dy = \int_{\mathbb{R}^d} \widehat{G(\delta \cdot)}(y - x) f(y) dy \\ &= \int_{\mathbb{R}^d} \widehat{G(\delta \cdot)}(y) f(y + x) dy = \int_{\mathbb{R}^d} G(\delta \xi) \widehat{f(\cdot + x)}(\xi) d\xi = \int_{\mathbb{R}^d} e^{-\pi\delta^2|\xi|^2} \widehat{f}(\xi) e^{2\pi i \xi \cdot x} d\xi. \end{aligned}$$

这证明了(2.7.5).

对任意 $x \in \mathbb{R}^d$ 有

$$\lim_{\delta \rightarrow 0+} e^{-\pi\delta^2|\xi|^2} \widehat{f}(\xi) e^{2\pi i \xi \cdot x} = \widehat{f}(\xi) e^{2\pi i \xi \cdot x}, \quad |e^{-\pi\delta^2|\xi|^2} \widehat{f}(\xi) e^{2\pi i \xi \cdot x}| \leq |\widehat{f}(\xi)| \quad \forall \xi \in \mathbb{R}^d, \forall \delta > 0.$$

因 $\widehat{f} \in L^1(\mathbb{R}^d)$, 故由连续参量的Lebesgue 控制收敛定理有

$$\lim_{\delta \rightarrow 0+} (G_{\delta} * f)(x) = \int_{\mathbb{R}^d} \widehat{f}(\xi) e^{2\pi i \xi \cdot x} d\xi \quad (\forall x \in \mathbb{R}^d).$$

由此和(2.7.4)即得

$$f(x) = \lim_{k \rightarrow \infty} (G_{\delta_k} * f)(x) = \int_{\mathbb{R}^d} \widehat{f}(\xi) e^{2\pi i \xi \cdot x} d\xi \quad \text{a.e. } x \in \mathbb{R}^d. \quad \square$$

【命题2.7.5(Fourier 反演公式的推论)】 设 $f, \widehat{f}, g, \widehat{g} \in L^1(\mathbb{R}^d)$.

若 $\widehat{f} = \widehat{g}$ 于 \mathbb{R}^d , 则 $f = g$ a.e. 于 \mathbb{R}^d . 特别若 $\widehat{f} = 0$ 于 \mathbb{R}^d , 则 $f = 0$ a.e. 于 \mathbb{R}^d .

【证】 令 $h = f - g$. 则 $\widehat{h} = \widehat{f} - \widehat{g} = 0$ 于 \mathbb{R}^d . 据Fourier 反演公式知 $h = 0$ a.e. 于 \mathbb{R}^d .

□

§2.8. 积分换元公式

积分换元公式与Fubini定理和Newton-Leibniz 公式一起是研究积分和计算积分的主要工具. 回想不定积分的计算, 如果没有积分换元公式, 很多不定积分将难以“积出”. 从证明的难度上看, 积分换元公式也是分析学中是能量较大的定理之一: 在较长篇幅的证明中一劳永逸地吸收了很多公共难点.

积分换元公式是宏观量之间的等量转换, 但是它的证明过程却着力于微观、局部分析. 我们马上看到, 测度和积分在一点附近的行为由换元映射的线性主部决定, 也即是“微分”的行为. 简单地说, 换元公式的证明过程就是化整为零、积零为整的过程.

与Riemann 积分换元公式相比, 本节学习的Lebesgue积分换元公式, 条件很弱: 只要求被积函数 f 可积或非负可测, 同时只要求换元映射 φ 是 C^1 -类的单射, 不要求它的Jacobi矩阵处处可逆, 因此应用更加广泛。

我们先从 C^1 映射下的测度估计开始. 如前, 我们用

$$\varphi'(x) = J\varphi(x) = \left(\frac{\partial \varphi_i}{\partial x_j}(x) \right)_{d \times d}$$

表示映射 $\varphi = (\varphi_1, \varphi_2, \dots, \varphi_d)^\tau$ 在 x 点的微分即Jacobi 矩阵.

【定理2.8.1(C^1 变换下的测度估计)】 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, $\varphi: \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 为 C^1 映射. 则对任何可测集 $E \subset \Omega$ 有

$$m(\varphi(E)) \leq \int_E |\det \varphi'(x)| dx. \quad (2.8.1)$$

【证】 首先由 C^1 映射把零测集映为零测集、把可测集映为可测集(定理1.5.2) 知 φ 把 Ω 中的零测集映为零测集, 把 Ω 中的可测集映为可测集. 不等式(2.8.1)的证明分几步进行.

Step 1. 证明局部性质: 对任意 $x \in \Omega$ 和包含 x 的任意闭方体族 $\{Q\}$ 都有

$$\limsup_{Q \ni x, l(Q) \rightarrow 0} \frac{m(\varphi(Q))}{m(Q)} \leq |\det \varphi'(x)|. \quad (2.8.2)$$

意即 $\forall x \in \Omega, \forall \varepsilon > 0, \exists \delta > 0$ 使得对于 Ω 中所有满足 $Q \ni x$ 且棱长 $l(Q) < \delta$ 的闭方体 Q 都有

$$\frac{m(\varphi(Q))}{m(Q)} < |\det \varphi'(x)| + \varepsilon.$$

为证明这个估计, 给定任一 $x_0 \in \Omega$, 记 $A = \varphi'(x_0)$. 取 $\delta_0 > 0$ 充分小使得 $B(x_0, \delta_0) \subset \Omega$. 考虑闭单位方体 $[0, 1]^d$ 在变换 $x \mapsto Ax$ 下的象 $K := A([0, 1]^d)$. 由Lebesgue 可测集的正

则性, 对任意 $\varepsilon > 0$, 存在开集 $G \supset K$ 使得 $m(G) < m(K) + \varepsilon$. 因 K 是紧集, $G^c = \mathbb{R}^d \setminus G$ 是闭集, 且 K, G^c 不相交, 故 $\text{dist}(G^c, K) > 0$. 取 $0 < r < \text{dist}(G^c, K)$, 则易见有

$$\{x \in \mathbb{R}^d \mid \text{dist}(x, K) \leq r\} \subset G. \quad (2.8.3)$$

由 φ 可微知, 存在 $0 < \delta < \delta_0/\sqrt{d}$ 使得

$$|\varphi(x) - \varphi(x_0) - A(x - x_0)| \leq \frac{r}{\sqrt{d}}|x - x_0| \quad \forall |x - x_0| < \sqrt{d}\delta. \quad (2.8.4)$$

设 Q 是满足 $Q \ni x_0$ 且棱长 $\lambda := l(Q) < \delta$ 的任一闭方体. 则有

$$\forall x \in Q \implies |x - x_0| \leq \sqrt{d}\lambda < \sqrt{d}\delta < \delta_0 \implies x \in B(x_0, \delta_0) \subset \Omega.$$

这表明 $Q \subset \Omega$. 写 $Q = \prod_{i=1}^d [a_i, a_i + \lambda]$ 并令 $a = (a_1, a_2, \dots, a_d)^\tau$. 则对任意 $x \in Q$ 有 $\frac{x-a}{\lambda} \in [0, 1]^d$ 从而有 $A(\frac{x-a}{\lambda}) \in A([0, 1]^d) = K$. 于是由 (2.8.4) 有 (注意 $x \mapsto Ax$ 是线性映射!)

$$\begin{aligned} \text{dist}\left(\frac{\varphi(x) - \varphi(x_0) - A(a - x_0)}{\lambda}, K\right) &\leq \left|\frac{\varphi(x) - \varphi(x_0) - A(a - x_0)}{\lambda} - A\left(\frac{x-a}{\lambda}\right)\right| \\ &= \frac{1}{\lambda} |\varphi(x) - \varphi(x_0) - A(x - x_0)| \leq \frac{1}{\lambda} \frac{r}{\sqrt{d}} |x - x_0| \leq \frac{1}{\lambda} \frac{r}{\sqrt{d}} \cdot \sqrt{d}\lambda = r. \end{aligned}$$

据 (2.8.3) 知

$$\frac{\varphi(x) - \varphi(x_0) - A(a - x_0)}{\lambda} \in G \quad \text{即} \quad \varphi(x) \in \lambda G + h$$

其中 $h = \varphi(x_0) + A(a - x_0)$. 这表明 $\varphi(Q) \subset \lambda G + h$. 于是由 **定理1.5.3(平移和线性变换下Lebesgue测度的计算公式)** 以及 $m(Q) = \lambda^d$ 和 $m(K) = m(A([0, 1]^d)) = |\det A|$ 得到

$$m(\varphi(Q)) \leq m(\lambda G) = \lambda^d m(G) < \lambda^d (m(K) + \varepsilon) = m(Q)(|\det A| + \varepsilon).$$

这就给出所要的估计

$$\frac{m(\varphi(Q))}{m(Q)} < |\det A| + \varepsilon.$$

Step2. 证明: 对任意闭方体 $Q \subset \Omega$ 都有

$$m(\varphi(Q)) \leq \int_Q |\det \varphi'(x)| dx. \quad (2.8.5)$$

反证法: 假设存在闭方体 $Q \subset \Omega$ 使 (2.8.5) 不成立. 令

$$\delta = \frac{1}{m(Q)} \left(m(\varphi(Q)) - \int_Q |\det \varphi'(x)| dx \right).$$

则 $\delta > 0$ 且

$$m(\varphi(Q)) = \int_Q (|\det \varphi'(x)| + \delta) dx.$$

将 Q 的每条棱 2 等分, 得到 2^d 个互不重叠的闭子方体 I_1, I_2, \dots, I_{2^d} , $Q = \bigcup_{i=1}^{2^d} I_i$.

由 $\varphi(Q) = \bigcup_{i=1}^{2^d} \varphi(I_i)$ 和测度的次可加性和积分的可加性得到

$$\sum_{i=1}^{2^d} m(\varphi(I_i)) \geq m(\varphi(Q)) = \sum_{i=1}^{2^d} \int_{I_i} (|\det \varphi'(x)| + \delta) dx.$$

由此可知存在某个 I_i , 记之为 Q_1 , 使得

$$m(\varphi(Q_1)) \geq \int_{Q_1} (|\det \varphi'(x)| + \delta) dx, \quad l(Q_1) = \frac{1}{2} l(Q).$$

再将 Q_1 的每条棱 2 等分, 得到 2^d 个互不重叠的闭子方体 J_1, J_2, \dots, J_{2^d} , $Q_1 = \bigcup_{i=1}^{2^d} J_i$.

由 $\varphi(Q_1) = \bigcup_{i=1}^{2^d} \varphi(J_i)$ 和如上分析得到

$$\sum_{i=1}^{2^d} m(\varphi(J_i)) \geq m(\varphi(Q_1)) \geq \sum_{i=1}^{2^d} \int_{J_i} (|\det \varphi'(x)| + \delta) dx.$$

因此存在某个 J_i , 记之为 Q_2 , 使得

$$m(\varphi(Q_2)) \geq \int_{Q_2} (|\det \varphi'(x)| + \delta) dx, \quad l(Q_2) = \frac{1}{2} l(Q_1) = \frac{1}{4} l(Q).$$

如此操作下去我们得到 Q 中的闭方体套

$$Q_1 \supset Q_2 \supset \dots \supset Q_k \supset \dots; \quad l(Q_k) = 2^{-k} l(Q), \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

满足

$$m(\varphi(Q_k)) \geq \int_{Q_k} (|\det \varphi'(x)| + \delta) dx, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

根据紧集套定理, 存在 $x_0 \in \bigcap_{k=1}^{\infty} Q_k$. 另一方面, 由中值定理(因 $x \mapsto \det \varphi'(x)$ 连续)

$$\exists x_k \in Q_k \text{ s.t. } \frac{1}{m(Q_k)} \int_{Q_k} (|\det \varphi'(x)| + \delta) dx = |\det \varphi'(x_k)| + \delta, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

于是有

$$\frac{m(\varphi(Q_k))}{m(Q_k)} \geq |\det \varphi'(x_k)| + \delta, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

因 $|x_k - x_0| \leq \text{diam}(Q_k) = \sqrt{d} l(Q_k) \rightarrow 0 (k \rightarrow \infty)$, 故由(2.8.2)得到矛盾:

$$|\det \varphi'(x_0)| \geq \limsup_{k \rightarrow \infty} \frac{m(\varphi(Q_k))}{m(Q_k)} \geq |\det \varphi'(x_0)| + \delta > |\det \varphi'(x_0)|.$$

Step 3. 证明: 对任意闭方体 $Q \subset \Omega$ 和任意可测集 $E \subset Q$ 都有

$$m(\varphi(E)) \leq \int_E |\det \varphi'(x)| dx. \quad (2.8.6)$$

给定 Q, E 如上. 我们有 $\varphi(E) \subset \varphi(E \cap Q^\circ) \cup \varphi(\partial Q)$. 因 ∂Q 是 Ω 中的零测集, 故 $\varphi(\partial Q)$ 是零测集. 于是有 $m(\varphi(E)) = m(\varphi(E \cap Q^\circ))$. 这表明, 以 $E \cap Q^\circ$ 代替 E , 我们可以假定 $E \subset Q^\circ$. 我们先证明 (2.8.6) 对于 Q° 中的开集成立. 设开集 $G \subset Q^\circ$. 由开集的方体分解定理(定理1.2.2(开集的方体分解)) 可写 $G = \bigcup_{k=1}^{\infty} \overline{Q}_k$, 其中 \overline{Q}_k 是互不重叠的闭方体. 应用测度的次可加性、**Step 2**、和互不重叠时的积分可加性有

$$m(\varphi(G)) \leq \sum_{k=1}^{\infty} m(\varphi(\overline{Q}_k)) \leq \sum_{k=1}^{\infty} \int_{\overline{Q}_k} |\det \varphi'(x)| dx = \int_{\bigcup_{k=1}^{\infty} \overline{Q}_k} |\det \varphi'(x)| dx = \int_G |\det \varphi'(x)| dx.$$

对于一般的可测集 $E \subset Q^\circ$, 应用开集逼近, 存在一列开集 G_k 满足 $E \subset G_k \subset Q^\circ$ 使得 $m(G_k \setminus E) \rightarrow 0$ ($k \rightarrow \infty$). 注意到闭方体 $Q \subset \Omega$ 蕴含 $\int_Q |\det \varphi'(x)| dx < \infty$, 于是应用定理2.2.7(积分的绝对连续性) 得到

$$m(\varphi(E)) \leq m(\varphi(G_k)) \leq \int_{G_k} |\det \varphi'(x)| dx \rightarrow \int_E |\det \varphi'(x)| dx \quad (k \rightarrow \infty).$$

这证明了 (2.8.6).

Step 4. 由开集的方体分解定理知 $\Omega = \bigcup_{k=1}^{\infty} \overline{Q}_k$ 其中 \overline{Q}_k 是互不重叠的闭方体. 对任意可测集 $E \subset \Omega$, 考虑分解

$$E = \bigcup_{k=1}^{\infty} E \cap \overline{Q}_k, \quad \varphi(E) = \bigcup_{k=1}^{\infty} \varphi(E \cap \overline{Q}_k).$$

则由**Step 3** 并注意 $E \cap \overline{Q}_k$ 也是互不重叠的, 得到

$$\begin{aligned} m(\varphi(E)) &\leq \sum_{k=1}^{\infty} m(\varphi(E \cap \overline{Q}_k)) \leq \sum_{k=1}^{\infty} \int_{E \cap \overline{Q}_k} |\det \varphi'(x)| dx \\ &= \int_{\bigcup_{k=1}^{\infty} E \cap \overline{Q}_k} |\det \varphi'(x)| dx = \int_E |\det \varphi'(x)| dx. \end{aligned} \quad \square$$

作为上述定理的重要推论, 我们立即得到

【Sard 定理: C^1 映射的临界值是零测集】 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, $\varphi: \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 为 C^1 映射, $S = \{x \in \Omega \mid \det \varphi'(x) = 0\}$ 是 φ 的临界点的集合, 则 φ 的临界值的集合 $\varphi(S)$ 是零测集, 即 $m(\varphi(S)) = 0$.

【证】在定理2.8.1(C^1 变换下的测度估计)中取 $E = S$ 即得证. \square

有了以上准备, 我们可以叙述并证明重积分换元公式.

【定理2.8.2(积分换元公式)】设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, $\varphi: \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 为 C^1 类的单射.

(a) 若 $f \in L^1(\varphi(\Omega))$ 或 f 在 $\varphi(\Omega)$ 上非负可测, 则成立换元公式:

$$\int_{\varphi(\Omega)} f(y)dy = \int_{\Omega} f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx \quad (2.8.7)$$

(b) 一般地, 设可测集 $E \subset \Omega$, 函数 $f \in L^1(\varphi(E))$ 或 f 在 $\varphi(E)$ 上非负可测. 则有

$$\int_{\varphi(E)} f(y)dy = \int_E f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx. \quad (2.8.8)$$

以上(a),(b) 分别包含了函数 $x \mapsto f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|$ 在 Ω 和 E 上的可积性和相应的非负可测性. 特别在(b)中取 $f \equiv 1$ 有

$$m(\varphi(E)) = \int_E |\det\varphi'(x)|dx. \quad (2.8.9)$$

【证】先证明(a) 蕴含(b). 设 $E \subset \Omega$ 为可测集. 由 $\varphi \in C^1(\Omega, \mathbb{R}^d)$ 和 C^1 映射把可测集映为可测集(定理1.5.2) 知 $\varphi(E)$ 是可测集. 因此 $\mathbf{1}_{\varphi(E)}(y)$ 是可测函数. 设 $f(y)$ 在 $\varphi(E)$ 上 L -可积或非负可测. 则函数 $\mathbf{1}_{\varphi(E)}(y)f(y)$ 在 $\varphi(\Omega)$ 上 L -可积或非负可测. 于是将(a) 应用于被积函数 $\mathbf{1}_{\varphi(E)}(y)f(y)$ 并注意 φ 是单射蕴含 $\mathbf{1}_{\varphi(E)}(\varphi(x)) = \mathbf{1}_E(x)$ 即知函数

$$x \mapsto \mathbf{1}_{\varphi(E)}(\varphi(x))f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)| = \mathbf{1}_E(x)f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|, \quad x \in \Omega$$

在 Ω 上的可积性和相应的非负可测性. 这就蕴含了函数 $x \mapsto f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|$ 在 E 上的可积性和相应的非负可测性. 同时由(2.8.7) 有

$$\begin{aligned} \int_{\varphi(E)} f(y)dy &= \int_{\varphi(\Omega)} \mathbf{1}_{\varphi(E)}(y)f(y)dy = \int_{\Omega} \mathbf{1}_{\varphi(E)}(\varphi(x))f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx \\ &= \int_{\Omega} \mathbf{1}_E(x)f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx = \int_E f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx. \end{aligned}$$

下面证明(a). 分两步进行.

Step 1. 假设 φ 满足 $\det\varphi'(x) \neq 0 \forall x \in \Omega$. 来证明此时换元公式(2.8.7)成立. 注意此时 $\varphi(\Omega)$ 是开集且逆映射 $\varphi^{-1}: \varphi(\Omega) \rightarrow \Omega$ 也是 C^1 的. 因此再由 C^1 映射把可测集映为可测集(定理1.5.2) 知 φ^{-1} 把 $\varphi(\Omega)$ 中的可测集映为可测集并且当 $f(y)$ 在 $\varphi(\Omega)$ 上可测时, 函数 $x \mapsto f(\varphi(x))$ 在 Ω 上可测.

首先证明: 对于 $\varphi(\Omega)$ 上的任意非负可测函数 f , 换元公式(2.8.7) 成立. 为此我们先证明

$$\int_{\varphi(\Omega)} f(y)dy \leq \int_{\Omega} f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx. \quad (2.8.10)$$

为证明(2.8.10), 先考虑简单情形: $f(y) = \mathbf{1}_A(y)$ 其中 $A \subset \varphi(\Omega)$ 是可测集. 由定理2.8.1(C^1 变换下的测度估计) 有

$$\begin{aligned} \int_{\varphi(\Omega)} \mathbf{1}_A(y)dy &= m(A) = m(\varphi(\varphi^{-1}(A))) \leq \int_{\varphi^{-1}(A)} |\det\varphi'(x)|dx \\ &= \int_{\Omega} \mathbf{1}_{\varphi^{-1}(A)}(x)|\det\varphi'(x)|dx = \int_{\Omega} \mathbf{1}_A(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx. \end{aligned}$$

现在设 f 是 $\varphi(\Omega)$ 上的任一非负可测函数. 由非负可测函数的级数表示知存在一系列可测集 $A_k \subset \varphi(\Omega)$ 和一系列常数 $c_k > 0$ 使得

$$f(y) = \sum_{k=1}^{\infty} c_k \mathbf{1}_{A_k}(y), \quad y \in \Omega.$$

由非负可测函数级数的逐项积分和关于特征函数的结果得到

$$\begin{aligned} \int_{\varphi(\Omega)} f(y)dy &= \sum_{k=1}^{\infty} c_k \int_{\varphi(\Omega)} \mathbf{1}_{A_k}(y)dy \leq \sum_{k=1}^{\infty} c_k \int_{\Omega} \mathbf{1}_{A_k}(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx \\ &= \int_{\Omega} \left(\sum_{k=1}^{\infty} c_k \mathbf{1}_{A_k}(\varphi(x)) \right) |\det\varphi'(x)|dx = \int_{\Omega} f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx. \end{aligned}$$

将这一结论应用于 C^1 单射 $\varphi^{-1}: \varphi(\Omega) \rightarrow \Omega$ 得到: 对于 Ω 上的任意非负可测函数 $g(x)$ 有

$$\int_{\Omega} g(x)dx = \int_{\varphi^{-1}(\varphi(\Omega))} g(x)dx \leq \int_{\varphi(\Omega)} g(\varphi^{-1}(y))|\det(\varphi^{-1})'(y)|dy.$$

回忆

$$|\det\varphi'(\varphi^{-1}(y))||\det(\varphi^{-1})'(y)| \equiv 1, \quad y \in \varphi(\Omega).$$

取 $g(x) = f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|$ 即得

$$\int_{\Omega} f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx \leq \int_{\varphi(\Omega)} f(\varphi(\varphi^{-1}(y)))|\det\varphi'(\varphi^{-1}(y))||\det(\varphi^{-1})'(y)|dx = \int_{\varphi(\Omega)} f(y)dy.$$

结合(2.8.10) 即知换元公式对于非负可测函数成立.

其次对于任意实值函数 $f \in L^1(\varphi(\Omega))$, 将上述结果应用于 f 的正部和负部得到(由可积性, 以下减法有意义!)

$$\begin{aligned} \int_{\varphi(\Omega)} f(y)dy &= \int_{\varphi(\Omega)} f^+(y)dy - \int_{\varphi(\Omega)} f^-(y)dy \\ &= \int_{\Omega} f^+(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx - \int_{\Omega} f^-(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx \\ &= \int_{\Omega} [f^+(\varphi(x)) - f^-(\varphi(x))]| \det\varphi'(x) |dx = \int_{\Omega} f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx. \end{aligned}$$

最后于任意复值函数 $f \in L^1(\varphi(\Omega))$, 将实值的结果应用于 f 的实部、虚部并注意复值函数积分的定义即知换元公式对于复值可积函数也成立.

Step 2. 去掉“ $\det \varphi'(x) \neq 0 \ \forall x \in \Omega$ ”的假设(只保持单射条件). 设 $f \in L^1(\varphi(\Omega))$ 或 f 在 $\varphi(\Omega)$ 上非负可测. 令

$$S = \{x \in \Omega \mid \det \varphi'(x) = 0\}, \quad \Omega_0 = \Omega \setminus S = \{x \in \Omega \mid \det \varphi'(x) \neq 0\}.$$

由**Sard定理**知 $\varphi(S)$ 为零测集. 因此有

$$\int_{\varphi(S)} f(y) dy = 0 = \int_S f(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)| dx. \quad (2.8.11)$$

由此可知若 $\Omega = S$, 则换元公式成立. 设 $\Omega \neq S$, 即 $\Omega_0 \neq \emptyset$. 则由 $x \mapsto \det \varphi'(x)$ 连续知 Ω_0 是非空开集. 因 $\det \varphi'(x) \neq 0$ for all $x \in \Omega_0$, 故由开映射定理知 $\varphi(\Omega_0)$ 是开集从而是 $\varphi(\Omega)$ 的可测子集. 这蕴含 f 在 $\varphi(\Omega_0)$ 上 L -可积或相应地非负可测. 于是由**Step1** 知 $x \mapsto f(\varphi(x))$ 在 Ω_0 上可测且

$$\int_{\varphi(\Omega_0)} f(y) dy = \int_{\Omega_0} f(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)| dx. \quad (2.8.12)$$

另一方面, 由 $m(\varphi(S)) = 0$ 有 $\int_{\varphi(S)} f(y) dy = 0$. 因此由 $\varphi(\Omega) = \varphi(\Omega_0) \cup \varphi(S)$ (不交并) 有

$$\int_{\varphi(\Omega)} f(y) dy = \int_{\varphi(\Omega_0)} f(y) dy. \quad (2.8.13)$$

而由 $\det \varphi'(x) = 0$ 于 S 知 $f(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)| = 0$ for all $x \in S$. 这蕴含函数 $x \mapsto f(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)|$ 在 $\Omega = \Omega_0 \cup S$ 上可测且

$$\int_{\Omega} f(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)| dx = \int_{\Omega_0} f(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)| dx. \quad (2.8.14)$$

联合(2.8.11)-(2.8.14) 即得换元公式(2.8.7). \square

【注1】 在上面的证明中我们从逻辑上考虑了 $\Omega = S$ 的情形. 实际上这种情形不会出现: 根据在《拓扑学》和《非线性分析》课程中将学到的**Brouwer 区域不变性定理**——从开集 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 到 \mathbb{R}^d 的连续单射必是开映射——知 $\varphi(\Omega)$ 是开集从而其测度 > 0 . 因 $\varphi(S)$ 是零测集, 故 $\varphi(\Omega) \setminus \varphi(S)$ 非空. 而由 φ 为单射知 $\varphi(\Omega \setminus S) = \varphi(\Omega) \setminus \varphi(S)$, 所以 $\Omega \setminus S$ 非空.

【注2】 在换元公式的应用中, “单射”是主要条件. 由于整体反函数问题是分析学中的一个难点, 单射的验证并不容易. 但对一些常用的变换(如球极坐标变换, 线性变换等), 单射条件不难验证.

很多情况下积分集合是闭区域. 对此我们有下列常用的换元公式, 其中不要求换元 $x \mapsto \varphi(x)$ 在整个闭区域上是单射, 而只要求它在闭区域的内部是单射.

【定理2.8.3(闭区域上的积分换元公式)】 设 $V \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, $\varphi : V \rightarrow \mathbb{R}^d$ 为 C^1 映射. 设开集 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 满足

(i) $\bar{\Omega} \subset V$ 且 $m(\partial\Omega) = 0$, (ii) $\varphi : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 为单射.

则对任意可测集 $E \subset \bar{\Omega}$ 有

$$m(\varphi(E)) = \int_E |\det \varphi'(x)| dx. \quad (2.8.15)$$

一般地, 对任何 $f \in L^1(\varphi(\bar{\Omega}))$ 或 f 在 $\varphi(\bar{\Omega})$ 上非负可测, 成立换元公式:

$$\int_{\varphi(\bar{\Omega})} f(y) dy = \int_{\bar{\Omega}} f(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)| dx. \quad (2.8.16)$$

【证】 首先由假设条件知 φ 在 Ω 上满足定理2.8.2(积分换元公式)中的条件, 因此换元公式(2.8.7)成立.

由闭包的定义和 Ω 为开集知 $\bar{\Omega} = \Omega \cup \partial\Omega$ 且 $\Omega \cap \partial\Omega = \emptyset$. 因 $\varphi : V \rightarrow \mathbb{R}^d$ 为 C^1 映射, $\partial\Omega \subset V$ 且 $\partial\Omega$ 为零测集, 故 $\varphi(\partial\Omega)$ 也是零测集. 对任意可测集 $E \subset \bar{\Omega}$, 由 $\bar{\Omega} = \Omega \cup \partial\Omega$ 有

$$\begin{aligned} E &= (E \cap \Omega) \cup (E \cap \partial\Omega), \quad m(E \cap \partial\Omega) = 0, \\ \varphi(E) &= \varphi(E \cap \Omega) \cup \varphi(E \cap \partial\Omega), \quad m(\varphi(E \cap \partial\Omega)) = 0 \end{aligned}$$

从而在换元公式(2.8.7)中取 $f(y) = \mathbf{1}_{\varphi(E \cap \Omega)}(y)$ 并注意 φ 在 Ω 上是单射蕴含

$$\mathbf{1}_{\varphi(E \cap \Omega)}(\varphi(x)) \equiv \mathbf{1}_{E \cap \Omega}(x), \quad x \in \Omega$$

便有

$$\begin{aligned} m(\varphi(E)) &= m(\varphi(E \cap \Omega)) = \int_{\varphi(\Omega)} \mathbf{1}_{\varphi(E \cap \Omega)}(y) dy = \int_{\Omega} \mathbf{1}_{\varphi(E \cap \Omega)}(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)| dx \\ &= \int_{\Omega} \mathbf{1}_{E \cap \Omega}(x) |\det \varphi'(x)| dx = \int_{E \cap \Omega} |\det \varphi'(x)| dx = \int_E |\det \varphi'(x)| dx. \end{aligned}$$

一般地, 对任意 $f \in L^1(\varphi(\bar{\Omega}))$ 或 f 在 $\varphi(\bar{\Omega})$ 上非负可测, 由定理2.8.2(积分换元公式)知

$$\int_{\varphi(\bar{\Omega})} f(y) dy = \int_{\bar{\Omega}} f(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)| dx.$$

而由 $\varphi(\bar{\Omega}) = \varphi(\Omega) \cup Z$, $Z = \varphi(\partial\Omega) \setminus \varphi(\Omega)$, $m(Z) = m(\partial\Omega) = 0$ 有

$$\int_Z f(y)dy = 0, \quad \int_{\partial\Omega} f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx = 0$$

于是由积分的可加性即得所证公式(2.8.14):

$$\begin{aligned} \int_{\varphi(\bar{\Omega})} f(y)dy &= \int_{\varphi(\Omega)} f(y)dy + \int_Z f(y)dy \\ &= \int_{\Omega} f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx + \int_{\partial\Omega} f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx \\ &= \int_{\bar{\Omega}} f(\varphi(x))|\det\varphi'(x)|dx. \end{aligned} \quad \square$$

【奇、偶函数的积分】

- 设可测集 $E \subset \mathbb{R}^d$ 关于某个 $d-1$ 维坐标平面对称, 即存在 $i \in \{1, 2, \dots, d\}$ 使得

$$x = (x_1, \dots, x_{i-1}, x_i, x_{i+1}, \dots, x_d) \in E \iff (x_1, \dots, x_{i-1}, -x_i, x_{i+1}, \dots, x_d) \in E.$$

(图示) 设函数 f 在 E 上有定义.

- (a) 假设 $f \in L^1(E)$ 且 $f(x)$ 关于 x 的第 i 个变量 x_i 是奇函数, 即

$$f(x_1, \dots, x_{i-1}, -x_i, x_{i+1}, \dots, x_d) = -f(x_1, \dots, x_{i-1}, x_i, x_{i+1}, \dots, x_d).$$

则有

$$\int_E f(x)dx = 0.$$

- (b) 假设 $f(x)$ 关于 x 的第 i 个变量 x_i 是偶函数, 即

$$f(x_1, \dots, x_{i-1}, -x_i, x_{i+1}, \dots, x_d) = f(x_1, \dots, x_{i-1}, x_i, x_{i+1}, \dots, x_d).$$

则当 $f \in L^1(E)$ 或 f 在 E 上非负可测时有

$$\int_E f(x)dx = 2 \int_{E_i^+} f(x)dx = 2 \int_{E_i^-} f(x)dx.$$

其中

$$E_i^+ = \{x = (x_1, x_2, \dots, x_d) \in E \mid x_i \geq 0\}, \quad E_i^- = \{x = (x_1, x_2, \dots, x_d) \in E \mid x_i \leq 0\}.$$

【证】考虑线性变换 $\varphi(x) = (x_1, \dots, x_{i-1}, -x_i, x_{i+1}, \dots, x_d)$, $x \in \mathbb{R}^d$. 显然 $|\det\varphi'(x)| \equiv 1$ 且由 E 的定义有

$$\varphi(E) = E, \quad \varphi(E_i^+) = E_i^-, \quad \varphi(E_i^-) = E_i^+.$$

(a): 设 f 是上述奇函数. 则由换元公式(2.8.8) 和 $f(\varphi(x)) = -f(x)$ 得到(在换元公式的左边, 将变量记号 y 也换成 x)

$$\int_E f(x)dx = \int_{\varphi(E)} f(x)dx = \int_E f(\varphi(x))dx = - \int_E f(x)dx.$$

因 $\int_E f(x)dx$ 是有限数(即不是无穷大), 故 $\int_E f(x)dx = 0$.

(b): 设 f 是上述偶函数. 则应用换元公式(2.8.8) 和 $E_i^+ = \varphi(E_i^-)$ 以及 $f(\varphi(x)) = f(x)$ 得到

$$\int_{E_i^+} f(x)dx = \int_{\varphi(E_i^-)} f(x)dx = \int_{E_i^-} f(\varphi(x))dx = \int_{E_i^-} f(x)dx.$$

因 $E = E_i^+ \cup E_i^-$ 且易见 E_i^+, E_i^- 不重叠, 即 $m(E_i^+ \cap E_i^-) = 0$, 故有

$$\int_E f(x)dx = \int_{E_i^+} f(x)dx + \int_{E_i^-} f(x)dx = 2 \int_{E_i^+} f(x)dx. \quad \square$$

• 设可测集 $E \subset \mathbb{R}^d$ 关于每个 $n-1$ 维坐标平面都对称, 即

$$x = (x_1, x_2, \dots, x_d) \in E \iff (\pm x_1, \pm x_2, \dots, \pm x_d) \in E.$$

设 E 上的函数 $f(x)$ 关于 x 的每个分量都是偶函数, 即

$$f(x_1, x_2, \dots, x_d) = f(\pm x_1, \pm x_2, \dots, \pm x_d), \quad x \in E.$$

则当 $f \in L^1(E)$ 或 f 在 E 上非负可测时有

$$\int_E f(x)dx = 2^d \int_{E \cap \mathbb{R}_+^d} f(x)dx. \quad (2.8.17)$$

其中 $\mathbb{R}_+ = [0, +\infty)$. 特别, 当 $E = \mathbb{R}^d$ 时有

$$\int_{\mathbb{R}^d} f(x)dx = 2^d \int_{\mathbb{R}_+^d} f(x)dx. \quad (2.8.18)$$

【证】公式(2.8.17) 可以用和上面相同的方法给予证明. 但较快的证法是利用Fubini定理先证(2.8.18) 然后由(2.8.18)推出(2.8.17). 当 $d = 1$ 时, (2.8.18) 是熟知的偶函数在对称区间上的积分等式. 假设当维数为 $d-1$ 时(2.8.18)成立, 则当维数等于 d 时, 由Fubini 定理和归纳假设有

$$\begin{aligned} \int_{\mathbb{R}^d} f(x)dx &= \int_{\mathbb{R}} \left(\int_{\mathbb{R}^{d-1}} f(x_1, x_2, \dots, x_{d-1}, x_d) dx_1 dx_2 \cdots dx_{d-1} \right) dx_d \\ &= 2^{d-1} \int_{\mathbb{R}} \left(\int_{\mathbb{R}_+^{d-1}} f(x_1, x_2, \dots, x_{d-1}, x_d) dx_1 dx_2 \cdots dx_{d-1} \right) dx_d \\ &= 2^d \int_{\mathbb{R}_+} \left(\int_{\mathbb{R}_+^{d-1}} f(x_1, x_2, \dots, x_{d-1}, x_d) dx_1 dx_2 \cdots dx_{d-1} \right) dx_d = 2^d \int_{\mathbb{R}_+^d} f(x)dx. \end{aligned}$$

所以(2.8.18) 成立.

对一般情形, 将已证的结果用于 \mathbb{R}^d 上的函数 $\mathbf{1}_E(x)f(x)$ (它在 \mathbb{R}^d 上显然满足上述偶函数条件)便有

$$\int_E f(x)dx = \int_{\mathbb{R}^d} \mathbf{1}_E(x)f(x)dx = 2^d \int_{\mathbb{R}_+^d} \mathbf{1}_E(x)f(x)dx = 2^d \int_{E \cap \mathbb{R}_+^d} f(x)dx. \quad \square$$

【Jacobi 矩阵行列式的其他记号】

对于光滑映射 $y = (y_1, y_2, \dots, y_d) = \varphi(x) = \varphi(x_1, x_2, \dots, x_d)$ 很多文献和教科书中常用下列比较直观的记号:

$$\det \varphi'(x) = \frac{\partial(y_1, y_2, \dots, y_d)}{\partial(x_1, x_2, \dots, x_d)} = \det \begin{pmatrix} \frac{\partial y_1}{\partial x_1} & \frac{\partial y_1}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial y_1}{\partial x_d} \\ \frac{\partial y_2}{\partial x_1} & \frac{\partial y_2}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial y_2}{\partial x_d} \\ \cdots & \cdots & \cdots & \cdots \\ \frac{\partial y_d}{\partial x_1} & \frac{\partial y_d}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial y_d}{\partial x_d} \end{pmatrix}.$$

相应的换元公式为

$$\int_{\varphi(\Omega)} f(y_1, y_2, \dots, y_d) dy_1 dy_2 \cdots dy_d = \int_{\Omega} f(\varphi(x_1, x_2, \dots, x_d)) \left| \frac{\partial(y_1, y_2, \dots, y_d)}{\partial(x_1, x_2, \dots, x_d)} \right| dx_1 dx_2 \cdots dx_d.$$

例如对于 $(x, y) = \varphi(u, v)$ 则有

$$\det \varphi'(u, v) = \frac{\partial(x, y)}{\partial(u, v)} = \det \begin{pmatrix} \frac{\partial x}{\partial u} & \frac{\partial x}{\partial v} \\ \frac{\partial y}{\partial u} & \frac{\partial y}{\partial v} \end{pmatrix},$$

$$\iint_{\varphi(\Omega)} f(x, y) dx dy = \iint_{\Omega} f(\varphi(u, v)) \left| \frac{\partial(x, y)}{\partial(u, v)} \right| du dv.$$

对于 $(x, y, z) = \varphi(u, v, w)$ 则有

$$\det \varphi'(u, v, w) = \frac{\partial(x, y, z)}{\partial(u, v, w)} = \det \begin{pmatrix} \frac{\partial x}{\partial u} & \frac{\partial x}{\partial v} & \frac{\partial x}{\partial w} \\ \frac{\partial y}{\partial u} & \frac{\partial y}{\partial v} & \frac{\partial y}{\partial w} \\ \frac{\partial z}{\partial u} & \frac{\partial z}{\partial v} & \frac{\partial z}{\partial w} \end{pmatrix},$$

$$\iiint_{\varphi(\Omega)} f(x, y, z) dx dy dz = \iiint_{\Omega} f(\varphi(u, v, w)) \left| \frac{\partial(x, y, z)}{\partial(u, v, w)} \right| du dv dw.$$

● 球极坐标变换

在数学分析中已经证明了一般维数的球极坐标变换在所示区域的内部是单射, 在区域的闭包上是满射, 因此满足换元公式的条件.

注意: 不失一般性我们只需考虑函数在全空间 \mathbb{R}^d 上的积分, 因为对于积分区域 $\neq \mathbb{R}^d$ 的情形, 通过将函数零延拓, 即将被积函数乘以原积分区域的特征函数, 即可化成全空间的积分.

极坐标变换($d = 2$):

$$\begin{cases} x = r \cos \theta \\ y = r \sin \theta \end{cases} \quad r \in [0, +\infty), \quad \theta \in [0, 2\pi] \text{ 或 } \theta \in [-\pi, \pi].$$

$$\left| \frac{\partial(x, y)}{\partial(r, \theta)} \right| = \left| \det \begin{pmatrix} \cos \theta & -r \sin \theta \\ \sin \theta & r \cos \theta \end{pmatrix} \right| = r$$

$$\begin{aligned} \iint_{\mathbb{R}^2} f(x, y) dx dy &= \iint_{[0, +\infty) \times [0, 2\pi]} f(r \cos \theta, r \sin \theta) r dr d\theta \\ &= \iint_{[0, +\infty) \times [-\pi, \pi]} f(r \cos \theta, r \sin \theta) r dr d\theta. \end{aligned}$$

【例】 计算 Gauss 积分: 由 Fubini 定理、极坐标换元公式和 Newton-Leibnitz 公式有

$$\begin{aligned} \left(\int_{\mathbb{R}} e^{-\pi x^2} dx \right)^2 &= \left(\int_{\mathbb{R}} e^{-\pi x^2} dx \right) \left(\int_{\mathbb{R}} e^{-\pi y^2} dy \right) \\ &= \iint_{\mathbb{R}^2} e^{-\pi x^2} e^{-\pi y^2} dx dy = \iint_{\mathbb{R}^2} e^{-\pi(x^2+y^2)} dx dy \\ &= \iint_{[0, +\infty) \times [0, 2\pi]} e^{-\pi r^2} r dr d\theta = 2\pi \int_0^\infty e^{-\pi r^2} r dr = -e^{-\pi r^2} \Big|_{r=0}^{r=+\infty} = 1. \end{aligned}$$

所以

$$\int_{\mathbb{R}} e^{-\pi x^2} dx = 1.$$

由此和指数函数的乘积结构和 Fubini 定理即得

$$\int_{\mathbb{R}^d} e^{-\pi |x|^2} dx = \int_{\mathbb{R}^d} e^{-\pi x_1^2} e^{-\pi x_2^2} \cdots e^{-\pi x_d^2} dx_1 dx_2 \cdots dx_d = \prod_{j=1}^d \int_{\mathbb{R}} e^{-\pi x_j^2} dx_j = 1.$$

球极坐标变换 ($d = 3$):

$$\begin{cases} x = r \sin \theta \cos \phi \\ y = r \sin \theta \sin \phi \\ z = r \cos \theta \end{cases} \quad r \in [0, +\infty), \quad \theta \in [0, \pi], \quad \phi \in [0, 2\pi].$$

$$\left| \frac{\partial(x, y, z)}{\partial(r, \theta, \phi)} \right| = \left| \det \begin{pmatrix} \sin \theta \cos \phi & r \cos \theta \cos \phi & -r \sin \theta \sin \phi \\ \sin \theta \sin \phi & r \cos \theta \sin \phi & r \sin \theta \cos \phi \\ \cos \theta & -r \sin \theta & 0 \end{pmatrix} \right| = r^2 \sin \theta,$$

$$\begin{aligned} & \iiint_{\mathbb{R}^3} f(x, y, z) dx dy dz \\ &= \iiint_{[0, +\infty) \times [0, \pi] \times [0, 2\pi]} f(r \sin \theta \cos \phi, r \sin \theta \sin \phi, r \cos \theta) r^2 \sin \theta dr d\theta d\phi. \end{aligned}$$

一般维数的球极坐标变换 ($d \geq 3$): d 维球极坐标变换

$$\Psi: [0, +\infty) \times [0, \pi]^{d-2} \times [0, 2\pi] \rightarrow \mathbb{R}^d, \quad (r, \theta_1, \theta_2, \dots, \theta_{d-1}) \mapsto x = \Psi(r, \theta_1, \theta_2, \dots, \theta_{d-1})$$

由下式给出:

$$\begin{aligned} x_1 &= \Psi_1(r, \theta_1, \theta_2, \dots, \theta_{d-1}) = r \cos \theta_1, \\ x_2 &= \Psi_2(r, \theta_1, \theta_2, \dots, \theta_{d-1}) = r \sin \theta_1 \cos \theta_2, \\ x_3 &= \Psi_3(r, \theta_1, \theta_2, \dots, \theta_{d-1}) = r \sin \theta_1 \sin \theta_2 \cos \theta_3, \\ &\dots\dots\dots \\ x_{d-1} &= \Psi_{d-1}(r, \theta_1, \theta_2, \dots, \theta_{d-1}) = r \sin \theta_1 \sin \theta_2 \cdots \sin \theta_{d-2} \cos \theta_{d-1}, \\ x_d &= \Psi_d(r, \theta_1, \theta_2, \dots, \theta_{d-1}) = r \sin \theta_1 \sin \theta_2 \cdots \sin \theta_{d-2} \sin \theta_{d-1}. \end{aligned}$$

在数学分析中已证明球极坐标变换 $\Psi: [0, +\infty) \times [0, \pi]^{d-2} \times [0, 2\pi] \rightarrow \mathbb{R}^d$ 是满射, 而 Ψ 在开区间 $(0, +\infty) \times (0, \pi)^{d-2} \times (0, 2\pi)$ 上是单射, 并经计算有

$$|\det \Psi'(r, \theta_1, \theta_2, \dots, \theta_{d-1})| = r^{d-1} \sin^{d-2} \theta_1 \sin^{d-3} \theta_2 \cdots \sin \theta_{d-2}.$$

因 Ψ 是光滑映射且 $(0, +\infty) \times (0, \pi)^{d-2} \times (0, 2\pi)$ 的边界是零测集, 故由定理2.8.3(闭区域上的换元公式) 知对任意 $f \in L^1(\mathbb{R}^d)$ 或 f 在 \mathbb{R}^d 上非负可测, 有

$$\begin{aligned} \int_{\mathbb{R}^d} f(x) dx &= \int_{[0, +\infty) \times [0, \pi]^{d-2} \times [0, 2\pi]} f(\Psi(r, \theta_1, \theta_2, \dots, \theta_{d-1})) \\ &\quad \times r^{d-1} \sin^{d-2} \theta_1 \sin^{d-3} \theta_2 \cdots \sin \theta_{d-2} dr d\theta_1 d\theta_2 \cdots d\theta_{d-1}. \end{aligned}$$

【径向函数的积分】 设 $d \geq 2$, $\mathbb{B}^d, \mathbb{S}^{d-1}$ 为闭单位球和单位球面, 即

$$\mathbb{B}^d = \{x \in \mathbb{R}^d \mid |x| \leq 1\}, \quad \mathbb{S}^{d-1} = \{x \in \mathbb{R}^d \mid |x| = 1\}.$$

设 \mathbb{R}^d 上的可积或非负可测函数 $f = f(|x|)$ 只依赖于 $|x|$, 则由

$$|\Psi(r, \theta_1, \theta_2, \dots, \theta_{d-1})| \equiv r$$

可知 f 的 d 维重积分可简化为一维积分:

$$\int_{\mathbb{R}^d} f(|x|) dx = \sigma(\mathbb{S}^{d-1}) \int_0^\infty f(r) r^{d-1} dr \quad (2.8.19)$$

其中 $\sigma(\mathbb{S}^{d-1})$ 是单位球面 \mathbb{S}^{d-1} 的面积即

$$\sigma(\mathbb{S}^{d-1}) = \int_{[0, \pi]^{d-2} \times [0, 2\pi]} \sin^{d-2} \theta_1 \sin^{d-3} \theta_2 \cdots \sin \theta_{d-2} d\theta_1 d\theta_2 \cdots d\theta_{d-1}.$$

【球体体积和球面面积的计算】 利用Gauss积分和径向函数的积分公式(2.8.19)有

$$1 = \int_{\mathbb{R}^d} e^{-\pi|x|^2} dx = \sigma(\mathbb{S}^{d-1}) \int_0^\infty r^{d-1} e^{-\pi r^2} dr.$$

作变量替换 $r = \sqrt{\frac{t}{\pi}}$ 计算: $dr = \frac{1}{2\sqrt{\pi}} t^{-\frac{1}{2}} dt$,

$$\int_0^\infty r^{d-1} e^{-\pi r^2} dr = \frac{1}{2} \left(\frac{1}{\pi}\right)^{\frac{d}{2}} \int_0^\infty t^{\frac{d}{2}-1} e^{-t} dt = \frac{1}{2\pi^{\frac{d}{2}}} \Gamma\left(\frac{d}{2}\right)$$

其中 $\Gamma(s) = \int_0^\infty t^{s-1} e^{-t} dt$ 为Gamma 函数($s > 0$). 于是得到 $\sigma(\mathbb{S}^{d-1}) = \frac{2\pi^{\frac{d}{2}}}{\Gamma(\frac{d}{2})}$. 对于闭单位球 \mathbb{B}^d , 令 $(\mathbb{B}^d)^\circ$ 为相应的开单位球, 即 $(\mathbb{B}^d)^\circ = \{x \in \mathbb{R}^d \mid |x| < 1\}$, 则易见 $\mathbf{1}_{\mathbb{B}^d}(x) = \mathbf{1}_{[0,1]}(|x|)$, $\mathbf{1}_{(\mathbb{B}^d)^\circ}(x) = \mathbf{1}_{[0,1)}(|x|)$. 因此应用径向函数的积分公式(2.8.19) 并注意 $\mathbf{1}_{[0,1)}(r)$ 与 $\mathbf{1}_{[0,1]}(r)$ 几乎处处相等, 有

$$m(\mathbb{B}^d) = m((\mathbb{B}^d)^\circ) = \sigma(\mathbb{S}^{d-1}) \int_0^\infty r^{d-1} \mathbf{1}_{[0,1]}(r) dr = \sigma(\mathbb{S}^{d-1}) \int_0^1 r^{d-1} dr = \frac{2\pi^{\frac{d}{2}}}{d\Gamma(\frac{d}{2})}.$$

综上得到

$$m(\mathbb{B}^d) = m((\mathbb{B}^d)^\circ) = \frac{2\pi^{\frac{d}{2}}}{d\Gamma(\frac{d}{2})}, \quad \sigma(\mathbb{S}^{d-1}) = \frac{2\pi^{\frac{d}{2}}}{\Gamma(\frac{d}{2})}.$$

为算出具体值, 可以利用Gamma 函数的递推关系:

$$\Gamma\left(\frac{1}{2}\right) = \sqrt{\pi}, \quad \Gamma(1) = 1, \quad \Gamma(s+1) = s\Gamma(s), \quad s > 0.$$

对一般开球 $B(a, r) = \{x \in \mathbb{R}^d \mid |x - a| < r\}$ 和闭球 $\overline{B}(a, r) = \{x \in \mathbb{R}^d \mid |x - a| \leq r\}$ 有

$$B(a, r) = a + r(\mathbb{B}^d)^\circ, \quad \overline{B}(a, r) = a + r\mathbb{B}^d$$

因此由平移和展缩变换的测度计算公式有

$$m(B(a, r)) = m(\overline{B}(a, r)) = r^d m(\mathbb{B}^d) = \frac{2\pi^{\frac{d}{2}}}{d\Gamma(\frac{d}{2})} r^d.$$

注意: $B(a, r)$ 的边界 (即以 a 为中心、 r 为半径的球面) 可写成

$$\partial B(a, r) = \partial \overline{B}(a, r) = \overline{B}(a, r) \setminus B(a, r)$$

故有

$$m(\partial B(a, r)) = m(\overline{B}(a, r)) - m(B(a, r)) = 0.$$

这表明 \mathbb{R}^d 中的球的边界是 d -维零测集.

【例】 设 $f: [0, +\infty) \rightarrow \mathbb{C}$ 具有需要的可积性, 将下面积分

$$I = \iiint_{x, y, z \geq 0, xy+yz+zx \leq 1} f(xy + yz + zx) dx dy dz$$

化成一维定积分.

【解】 因 $\{(x, y, z) \in \mathbb{R}_{\geq 0}^3 \mid x = 0 \text{ 或 } y = 0 \text{ 或 } z = 0\}$ 是零测集, 对积分无贡献, 故有

$$I = \iiint_{x, y, z > 0, xy+yz+zx \leq 1} f(xy + yz + zx) dx dy dz.$$

令

$$xy = u^2, \quad yz = v^2, \quad zx = w^2, \quad u, v, w > 0, \quad u^2 + v^2 + w^2 \leq 1$$

则有 $(xyz)^2 = xy yz zx = u^2 v^2 w^2$, $xyz = uvw$, $x = \frac{u^2}{y} = \frac{u^2 zx}{yzx} = \frac{u^2 w^2}{uvw} = \frac{uw}{v}$, $y = \frac{v^2}{z} = \frac{v^2 xy}{zxy} = \frac{v^2 u^2}{uvw} = \frac{uv}{w}$, $z = \frac{w^2}{x} = \frac{w^2 yz}{xyz} = \frac{vw^2}{uvw} = \frac{vw}{u}$ 所以

$$x = \frac{uw}{v}, \quad y = \frac{uv}{w}, \quad z = \frac{vw}{u}, \quad u, v, w > 0, \quad u^2 + v^2 + w^2 \leq 1.$$

这个 (x, y, z) 与 (u, v, w) 之间的变换是 (x, y, z) 的积分区域与 (u, v, w) 的积分区域 (即第一卦限中的单位球) 之间的光滑同胚. 计算

$$\begin{aligned} \left| \frac{\partial(x, y, z)}{\partial(u, v, w)} \right| &= \left| \det \begin{pmatrix} \frac{w}{v} & \frac{-uw}{v^2} & \frac{u}{v} \\ \frac{v}{w} & \frac{u}{w} & \frac{-uv}{w^2} \\ \frac{-vw}{u^2} & \frac{w}{u} & \frac{v}{u} \end{pmatrix} \right| \quad (\text{按第一行展开}) \\ &= \left| \frac{w}{v} \left(\frac{u}{w} \frac{v}{u} + \frac{w}{u} \frac{uv}{w^2} \right) + \frac{uw}{v^2} \left(\frac{v}{w} \frac{v}{u} - \frac{vw}{u^2} \frac{uv}{w^2} \right) + \frac{u}{v} \left(\frac{v}{w} \frac{w}{u} + \frac{vw}{u^2} \frac{u}{w} \right) \right| = 4. \end{aligned}$$

所以

$$\begin{aligned} I &= 4 \iint_{u,v,w>0} \mathbf{1}_{\{u^2+v^2+w^2<1\}} f(u^2+v^2+w^2) du dv dw \quad (\text{然后用球坐标变换}) \\ &= 4 \cdot \frac{4\pi}{8} \int_0^1 r^2 f(r^2) dr = \pi \int_0^1 f(t) \sqrt{t} dt. \quad \square \end{aligned}$$

本章后几节作业题

1. Stein和Shakarchi的《实分析》第2章第5节习题8, 15, 16.

2. 设 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, 函数 f 在 E 上有定义, 满足: 对任意 $\varepsilon > 0$ 存在 $g, h \in L^1(E)$ 使得 $g(x) \leq f(x) \leq h(x)$ for all $x \in E$ 并且

$$\int_E [h(x) - g(x)] dx < \varepsilon.$$

证明 $f \in L^1(E)$ (注意先证 f 在 E 上可测!).

3. 设 $f \in L^1(\mathbb{R}^d)$, $K \subset \mathbb{R}^d$ 是紧集. 证明

$$\lim_{|y| \rightarrow \infty} \int_{K+y} f(x) dx = 0.$$

4. 设 $0 \leq f \in L^1([0, \infty))$. (1) 证明

$$\sum_{k=0}^{\infty} \int_k^{k+2} f(x) dx \leq 2 \int_0^{\infty} f(x) dx.$$

(2) 设正数列 $\{a_n\}_{n=1}^{\infty}$ 满足: 每个长度为1 的区间至多含有 $\{a_n\}_{n=1}^{\infty}$ 中的5项. 证明 $\sum_{n=1}^{\infty} f(x + a_n) < \infty$ a.e. $x \in [0, \infty)$ 从而有 $\lim_{n \rightarrow \infty} f(x + a_n) = 0$ a.e. $x \in [0, \infty)$.

[提示: 先在 $[0, 1]$ 上积分, 考虑重组: $\sum_{n=1}^{\infty} = \sum_{k=0}^{\infty} \sum_{n \in S_k}$ 其中 $S_k = \{n \in \mathbb{N} \mid a_n \in [k, k+1)\}$, 规定空集上的求和为零.]

5. 设数列 $\{a_n\}_{n=1}^{\infty}$ 满足 $|a_n| \leq \log n$, $n = 2, 3, \dots$. 证明

$$\int_2^{\infty} \sum_{n=2}^{\infty} \frac{a_n}{n^x} dx = \sum_{n=2}^{\infty} \frac{a_n}{n^2 \log n}.$$

这里 $\log = \ln$.

6. 证明下列等式:

$$\int_0^{\infty} \frac{x^{\alpha-1}}{e^x - 1} dx = \Gamma(\alpha) \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^{\alpha}}, \quad \alpha > 1.$$

$$\int_0^\infty \frac{\sin(ax)}{e^x - 1} dx = \sum_{n=1}^\infty \frac{a}{n^2 + a^2}, \quad a > 0.$$

这里 $\Gamma(s) = \int_0^\infty t^{s-1} e^{-t} dt$ ($s > 0$) 是Gamma 函数.

7. 设 $f \in L^1(\mathbb{R})$, $a > 0$. 证明

$$S(x) := \sum_{n=-\infty}^\infty f\left(\frac{x}{a} + n\right)$$

在 \mathbb{R} 上几乎处处绝对收敛(从而几乎处处收敛) 并且和函数 $S(x)$ 是一个以 a 为周期的周期函数且 $S \in L^1([0, a])$.

8. 设 $f \in L^1(\mathbb{R})$. 试(通过级数收敛蕴含通项趋于零) 证明

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{f(nx)}{(\log n)^2} = 0 \quad \text{a.e.} \quad x \in \mathbb{R}.$$

9. 设 f 是 \mathbb{R} 上的周期函数, 周期为 $T > 0$. 设 $f \in L^1([0, T])$, 证明 f 在 \mathbb{R} 上可测且

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{f(nx)}{n^2} = 0 \quad \text{a.e.} \quad x \in \mathbb{R}.$$

10. 设 $E_n \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$, $m(E_n) < \infty$ 且

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_{\mathbb{R}^d} |\mathbf{1}_{E_n}(x) - f(x)| dx = 0.$$

证明存在 $E \in \mathcal{M}(\mathbb{R}^d)$ 使得 $f(x) = \mathbf{1}_E(x)$ a.e. $x \in \mathbb{R}^d$.

11. 设 $f \in L^1((0, \infty))$, g 在 $(0, \infty)$ 上可测且 $M := \sup_{x>0} \frac{|g(x)|}{x} < \infty$. 证明

$$\lim_{x \rightarrow +\infty} \frac{1}{x} \int_0^x f(t)g(t)dt = 0.$$

12. 设 $x^s f(x)$, $x^t f(x)$ 都在 $(0, \infty)$ 上可积, 其中 $s < t$. 证明对任意 $u \in [s, t]$, 函数 $x^u f(x)$ 在 $(0, \infty)$ 上可积且函数

$$g(u) := \int_0^\infty x^u f(x) dx \quad \text{在 } [s, t] \text{ 上连续.}$$

13. 试给出一列实函数 $\{g_n\}_{n=1}^\infty \subset C([0, 1]^d)$, 它在积分度量下是一个Cauchy 列, 即

$$\lim_{n, m \rightarrow \infty} \int_{[0, 1]^d} |g_n(x) - g_m(x)| dx = 0$$

但不存在 $f \in \mathcal{R}([0, 1]^d)$ 使得

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_{[0, 1]^d} |g_n(x) - f(x)| dx = 0.$$

由此说明(在积分度量下)Riemann 可积函数空间 $\mathcal{R}([0, 1]^d)$ 不是完备的。

14(关于Fubini定理的习题). Stein和Shakarchi的《实分析》第2章第5节习题17,18,19.

周民强《实变函数论》(第2版2008年, 北大出版社) P213 思考题1, 2, 3, 4; P224 习题30, 31, 32, 33, 34, P227 习题18, 19, 21, 23.

15. Stein和Shakarchi的《实分析》第2章第5节习题21, 22, 23, 24, 25; 第6节习题1, 2.

作业(2018-5-9)

- 把定理2.8.1 和其后的Sard 定理中的 “ $\varphi : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 属于 C^1 类” 换成 “ $\varphi : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 可微”, 证明结论仍成立。(详见下面学生作业1、2)

- 把换元公式定理2.8.2中的 “ $\varphi : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 属于 C^1 类” 换成 “ $\varphi : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 可微且 $\{x \in \Omega \mid \det \varphi'(x) \neq 0\}$ 是开集”, 证明结论仍成立。(详见下面学生作业3)

在证明中要用到《数学分析》课程中证明的下面定理(可以承认使用之)

【命题1 (可微映射的开映射定理)】 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, $\varphi : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 可微且 $\varphi'(x)$ 在 Ω 上处处可逆, 即 $\det \varphi'(x) \neq 0$ for all $x \in \Omega$. 则 φ 是开映射, 即对任意开集 $U \subset \Omega$, $\varphi(U)$ 是 \mathbb{R}^d 中的开集.

注意: 因定义域 Ω 和值域 $\varphi(\Omega)$ 都含于 \mathbb{R}^d , 故Jacobi矩阵 $\varphi'(x)$ 是方阵!

【证】 设开集 $U \subset \Omega$, 来证明 $\varphi(U)$ 是开集. 任取 $y_0 \in \varphi(U)$, 须证明存在 $\varepsilon > 0$ 使得 $B(y_0, \varepsilon) \subset \varphi(U)$. 写 $y_0 = \varphi(x_0)$, $x_0 \in U$. 令 $A = \varphi'(x_0)$.

由 φ 可微知 $\varphi(x) = \varphi(x_0) + A(x - x_0) + o(|x - x_0|)$ 即

$$\lim_{U \ni x \rightarrow x_0} \frac{|\varphi(x) - \varphi(x_0) - A(x - x_0)|}{|x - x_0|} = 0.$$

据此有: 存在 $\delta > 0$ 使得闭球 $\overline{B}(x_0, \delta) \subset U$ 且

$$\frac{|\varphi(x) - \varphi(x_0) - A(x - x_0)|}{|x - x_0|} < \frac{1}{2\|A^{-1}\|} \quad \forall x \in \overline{B}(x_0, \delta) \setminus \{x_0\}.$$

即

$$|\varphi(x) - \varphi(x_0) - A(x - x_0)| < \frac{|x - x_0|}{2\|A^{-1}\|} \quad \forall x \in \overline{B}(x_0, \delta) \setminus \{x_0\}.$$

这里 $\|\cdot\|$ 为矩阵范数. 由此有

$$\begin{aligned} |\varphi(x) - \varphi(x_0)| &\geq |A(x - x_0)| - |\varphi(x) - \varphi(x_0) - A(x - x_0)| \\ &> |A(x - x_0)| - \frac{|x - x_0|}{2\|A^{-1}\|} \geq \frac{|x - x_0|}{2\|A^{-1}\|} = \frac{\delta}{2\|A^{-1}\|} \quad \forall x \in \partial B(x_0, \delta) \end{aligned} \quad (*)$$

其中用到不等式

$$|x - x_0| = |A^{-1}A(x - x_0)| \leq \|A^{-1}\| |A(x - x_0)|.$$

令

$$\varepsilon = \frac{1}{2} \min_{x \in \partial B(x_0, \delta)} |\varphi(x) - \varphi(x_0)|.$$

则由(*) 知

$$\varepsilon \geq \frac{\delta}{4\|A^{-1}\|} > 0.$$

下证 $B(\varphi(x_0), \varepsilon) \subset \varphi(B(x_0, \delta))$. 任取 $y \in B(\varphi(x_0), \varepsilon)$. 我们有: 对任意 $x \in \partial B(x_0, \delta)$

$$|\varphi(x) - y| \geq |\varphi(x) - \varphi(x_0)| - |\varphi(x_0) - y| \geq 2\varepsilon - |\varphi(x_0) - y| > |\varphi(x_0) - y|. \quad (**)$$

设 $x_* \in \overline{B}(x_0, \delta)$ 是函数 $x \mapsto |\varphi(x) - y|^2$ 在闭球 $\overline{B}(x_0, \delta)$ 上的最小值点, 即

$$|\varphi(x_*) - y|^2 = \min_{x \in \overline{B}(x_0, \delta)} |\varphi(x) - y|^2$$

则由严格不等式(**)知 $x_* \notin \partial B(x_0, \delta)$. 因此 $x_* \in B(x_0, \delta)$. 因 $B(x_0, \delta)$ 是开集, 故存在 $\eta > 0$ 使得 $B(x_*, \eta) \subset B(x_0, \delta)$. 于是有 $|\varphi(x) - y|^2 \geq |\varphi(x_*) - y|^2$ for all $x \in B(x_*, \eta)$. 这表明点 $x_* \in B(x_0, \delta)$ 是函数 $x \mapsto |\varphi(x) - y|^2$ 在开球 $B(x_0, \delta)$ 内的一个极小值点. 据极值原理知

$$(|\varphi(x) - y|^2)'_x \Big|_{x=x_*} = 0.$$

在欧氏范数平方的微分关系式

$$(|g(x)|^2)' = 2g(x)^\tau g'(x)$$

中取 $g(x) = \varphi(x) - y$ 得到

$$0 = (|\varphi(x) - y|^2)'_x \Big|_{x=x_*} = 2(\varphi(x_*) - y)^\tau \varphi'(x_*).$$

而由假设知 $\varphi'(x_*)$ 可逆, 故得 $2(\varphi(x_*) - y)^\tau = 0$ 即 $\varphi(x_*) - y = 0$. 所以 $y = \varphi(x_*) \in \varphi(B(x_0, \delta))$. 这证明了 $B(y_0, \varepsilon) = B(\varphi(x_0), \varepsilon) \subset \varphi(B(x_0, \delta)) \subset \varphi(U)$. 由 $y_0 \in \varphi(U)$ 的任意性即知 $\varphi(U)$ 是开集. \square

【命题2 (可微映射的逆映射定理)】 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, $\varphi: \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 为单射、可微且 $\varphi'(x)$ 在 Ω 上处处可逆, 即 $\det \varphi'(x) \neq 0$ for all $x \in \Omega$. 则 $\varphi(\Omega)$ 是开集, 逆映射 $y \mapsto \varphi^{-1}(y)$ 在 $\varphi(\Omega)$ 上可微且

$$(\varphi^{-1})'(y) = [\varphi'(x)]^{-1} \Big|_{x=\varphi^{-1}(y)}, \quad y \in \varphi(\Omega).$$

[注: 为证命题2, 先应用命题1 证明逆映射 $y \mapsto \varphi^{-1}(y)$ 在 $\varphi(\Omega)$ 上连续。]

学生作业1. 证明 **【定理2.8.1*】** 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, $\varphi: \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 可微. 则对任何可测集 $E \subset \Omega$, 象集 $\varphi(E)$ 是可测集且

$$m(\varphi(E)) \leq \int_E |\det \varphi'(x)| dx. \quad (1)$$

证明步骤(供参考):

Step 0. 证明 $x \mapsto \det \varphi'(x)$ 是 Ω 上的可测函数.

Step 1. 证明 φ 把 Ω 中的零测集映为零测集从而把 Ω 中的可测集映为可测集[参见习题课].

Step 2. 证明对任意 $x_0 \in \Omega$, 对任意 $\varepsilon > 0$, 存在 $\delta = \delta_{x_0, \varepsilon} > 0$ 使得 $\overline{B}(x_0, \delta) \subset \Omega$ 且

$$\frac{m(\varphi(\overline{B}(x_0, r)))}{m(\overline{B}(x_0, r))} < |\det \varphi'(x_0)| + \varepsilon \quad \forall 0 < r \leq \delta.$$

证明中的核心一步是

$$\begin{aligned} \text{dist}\left(\frac{\varphi(x) - \varphi(x_0)}{r}, K\right) &\leq \left|\frac{\varphi(x) - \varphi(x_0)}{r} - A\left(\frac{x - x_0}{r}\right)\right| \\ &= \frac{|\varphi(x) - \varphi(x_0) - A(x - x_0)|}{r} \leq \eta \frac{|x - x_0|}{r} \leq \eta \quad \forall x \in \overline{B}(x_0, r), 0 < r \leq \delta \end{aligned}$$

其中

$$K = A(\overline{B}(0, 1)), \quad A = \varphi'(x_0).$$

Step 3. 设 $E \subset \Omega$ 为可测集, 满足存在常数 $0 < M < +\infty$ 使得 $|\det \varphi'(x)| \leq M$ for all $x \in E$. 证明

$$m(\varphi(E)) \leq Mm(E).$$

Step 4. 对任意可测集 $E \subset \Omega$ 满足 $m(E) < +\infty$, 证明

$$m(\varphi(E)) \leq \int_E |\det \varphi'(x)| dx.$$

Step 5. 对任意可测集 $E \subset \Omega$, 证明

$$m(\varphi(E)) \leq \int_E |\det \varphi'(x)| dx.$$

□

学生作业2. 证明【Srad定理*(可微映射的临界值是零测集)】设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, $\varphi: \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 可微, $S = \{x \in \Omega \mid \det \varphi'(x) = 0\}$. 则 $m(\varphi(S)) = 0$.

学生作业3. 证明【定理2.8.2*(积分换元公式)】设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, $\varphi: \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 为单射且可微, 并假设 $\{x \in \Omega \mid \det \varphi'(x) \neq 0\}$ 是开集.

(a) 若 $f \in L^1(\varphi(\Omega))$ 或 f 在 $\varphi(\Omega)$ 上非负可测, 则成立换元公式:

$$\int_{\varphi(\Omega)} f(y) dy = \int_{\Omega} f(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)| dx.$$

(b) 一般地, 设可测集 $E \subset \Omega$, 函数 $f \in L^1(\varphi(E))$ 或 f 在 $\varphi(E)$ 上非负可测. 则有

$$\int_{\varphi(E)} f(y) dy = \int_E f(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)| dx.$$

以上(a),(b) 分别包含了函数 $x \mapsto f(\varphi(x)) |\det \varphi'(x)|$ 在 Ω 和 E 上的可积性和相应的非负可测性. 特别在(b)中取 $f \equiv 1$ 有

$$m(\varphi(E)) = \int_E |\det \varphi'(x)| dx.$$

学生作业4. 本题是同维数Sard 定理的逆定理. 设 $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ 为开集, 映射 $\varphi: \Omega \rightarrow \mathbb{R}^d$ 和子集 $E \subset \Omega$ 满足: 对每个 $x \in E$, φ 在 x 可微; 象集 $\varphi(E)$ 是零测集, 即 $m(\varphi(E)) = 0$. 则有 $\det \varphi'(x) = 0$ a.e. $x \in E$.

学生作业5. 设实值函数 f 在开区间 $(a, b) \subset \mathbb{R}$ 上可测, $E \subset (a, b)$ 为可测集, f 在 E 中每点可微. 则 $f(E)$ 是可测集且

$$m(f(E)) \leq \int_E |f'(x)| dx.$$