



2014

年

李正元·李永乐

考研数学 1

数学

数学一

复习全书

- 主编 北京大学 李正元
清华大学 李永乐
北京大学 范培华

赠送《全书习题全解》

特殊防伪 盗版书将丢失重要信息



中国政法大学出版社



2014 年李正元·李永乐考研数学①

数学

数学一

复习全书

主编 北 京 大 学 李正元

清 华 大 学 李永乐

北 京 大 学 范培华

编者 (按姓氏笔画)

北 京 大 学 李正元

清 华 大 学 李永乐

北 京 大 学 刘西垣

北 京 大 学 范培华



中国政法大学出版社

2013 · 北京

图书在版编目(CIP)数据

2014 年李正元·李永乐考研数学·数学复习全书·数学一/李正元,李永乐,范培华主编. —北京:中国政法大学出版社,2013. 2

ISBN 978-7-5620-4665-3

I. ①2… II. ①李… ②李… ③范… III. ①高等数学-研究生-入学考试-自学参考资料
IV. ①O13

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2013)第 023644 号

书 名	2014 年李正元·李永乐考研数学·数学复习全书·数学一 2014NIAN LIZHENGYUAN · LIYONGLE KAOYANSHUXUE SHUXUEFUXIQUANSHU SHUXUEYI
出版发行	中国政法大学出版社(北京市海淀区西土城路 25 号) 北京 100088 信箱 8034 分箱 邮编 100088 fada.sf@sohu.com http://www.cuplpress.com (网络实名:中国政法大学出版社) (010)58908433(编辑部) 58908325(发行部) 58908334(邮购部)
承 印	北京朝阳印刷厂有限责任公司
规 格	787mm×1092mm 1/16
印 张	52
字 数	1390 千字
版 本	2013 年 2 月第 1 版 2013 年 2 月第 1 次印刷
书 号	ISBN 978-7-5620-4665-3/O
定 价	64.80 元

声 明

1. 版权所有,侵权必究。
2. 如有缺页、倒装问题,由印刷厂负责退换。

新版前言

本书出版、修订多年来，深受全国广大考生的好评和厚爱，受到专家同行的肯定，认为本书在编写体例上有“特色”，在内容讲解、试题分析与解答上详尽、透彻、易懂，较“适合考生的需要”。我们从反馈的信息中获悉，除报考硕士研究生的考生将本书用作应试复习参考书外，工科类在读大学生也将本书作为数学的学习辅导资料，而教师则作为主要的教学参考用书之一。这既是对我们工作的肯定和鼓励，也是一种鞭策，促使我们对本书进一步完善，更好地适应和满足广大考生和读者考试复习的需要。2014年版《数学复习全书》将以更高的质量和新的面貌呈现在广大学生的面前。

本书2014年版是在2013年版的基础上进行修订的，更加完善，更具有针对性和适用性。

高等数学部分：按考试大纲的要求及绝大多数考生系统复习的需要，本书进行了调整，宗旨是重点内容重点讲解，如：求极限的方法，求积分（一元、多元函数）的方法，牛顿-莱布尼兹公式及其应用，二重积分的计算与应用，泰勒公式及其应用，求幂级数的收敛域或收敛区间，幂级数的求和，求函数的幂级数展开式等单独分离出来进行举例讲解，同时调换并增加了若干典型例题，并修改了部分例题的解法，使之更简捷，更易掌握。

线性代数部分：主要是针对一些重点概念和公式的运用，调换并增加了若干例题进行讲解，使考生对这些重点概念和公式能彻底理解、吃透，对一些常考题型，如：抽象行列式的计算，有关伴随矩阵的命题， n 阶矩阵的特征值和特征向量以及线性相关与无关的证明、基础解系的证明等题型的解题方法和技巧进一步作了较详尽的归纳总结，并给典型例题进行讲解，消除考生对这些重要概念和公式的运用和常考题型解题方法的疑惑，以便考生在考试中应对自如，提高应试水平。

概率统计部分：与高等数学部分一样也进行了调整，调整后更适合考生进行系统复习，同时对重点概念、公式和常考题型从多角度命制典型例题进行讲解，以提高考生运用概念、公式综合分析能力，从而取得好成绩。

特别需要强调的是，本书题型训练试题均给出了详细解答（见赠书）。

本书高等数学部分由北京大学李正元修改完成，线性代数部分由清华大学李永乐修改完成，概率论与数理统计部分由北京大学范培华修改完成。

编者

2013年2月

前 言

为了使考研同学能在较短时间内全面复习数学,达到硕士学习阶段应具备的数学能力,提高考研应试水平,以合格的数学成绩任国家挑选,作者根据教育部制订的《数学考试大纲》的要求和最新精神,深入研究了近年来考研命题的特点及动态,并结合作者多年来数学阅卷以及全国大部分城市“考研班”辅导的经验,编写了这本《考研数学复习全书》及其姊妹篇《考研数学历年试题解析》、《考研数学全真模拟经典400题》等。在编写时,作者特别注重与学生的实际相结合,注重与考研的要求相结合。

本书每章均由以下五个部分构成:

一、知识结构网络图——编写该部分的目的主要让考生弄清各知识点之间的相互联系,以便对各章内容有一个全局性的认识和把握。

二、内容概要与重难点提示——编写该部分的目的主要使考生能明确本章的重点、难点及常考点,以便在复习中有的放矢,提高效率。

三、考核知识要点讲解——本部分对大纲所要求的知识点进行了全面地阐述,并对考试重点、难点以及常考点进行了剖析,指出了历届考生在运用基本概念、公式、定理等知识解题时普遍存在的问题及常犯的错误,同时给出了相应的注意事项,以加深考生对基本概念、公式、定理等重点内容的理解和正确应用。

四、常考题型及其解题方法与技巧——本部分对历年统考中常见题型进行了归纳分类,归纳总结了各种题型的解题方法,注重一题多解,以期开阔考生的解题思路,使所学知识融会贯通,并能综合、灵活地解决问题。

五、题型训练及参考答案——本部分精选了适量的自测题,并附有参考答案和解题提示。只有适量的练习才能巩固所学知识,复习数学必须做题。为了让考生更好地巩固所学知识,提高实际解题能力,作者特优化设计了与真题相仿的实战训练题编写在《考研数学全真模拟经典400题》一书中,以供考生选用。

特别需要强调的是,在'98北大百年校庆之际,我们北大数学系63届校友聚会于北大燕园,畅谈中得知我们当中许多同学都在从事本科及研究生数学教学与数学研究工作,并有多年的考研辅导的经验以及参加研究生入学考试阅卷的经历,对各类院校的考生有广泛的接触与了解,深知考生在考研数学备考中所面临的困惑。为了帮助考生全面系统并有针对性地复习,在大家的一致建议下,由我们执笔编写了这本《考研数学复习全书》及其姊妹篇《考研数学历年试题解析》、《考研数学全真模拟经典400题》等,期望对广大考生备考能有所裨益。

本书是考研应试者的良师益友,也是各类院校的学生自学数学、提高数学水平和教师进行教学辅导的一本极有价值的参考书。

由于时间仓促,书中疏漏之处在所难免,诚请专家和读者指正。

编 者

1999年4月于北大燕园

第一篇 高等数学

第一章 极限、连续与求极限的方法…… (1)

知识结构网络图 …………… (1)

内容概要与重难点提示 …………… (1)

考核知识要点讲解 …………… (2)

一、极限的概念与性质 …………… (2)

二、极限存在性的判别 (极限存在的
两个准则) …………… (4)

三、求极限的方法 …………… (6)

四、无穷小及其比较 …………… (14)

五、函数的连续性及其判断 …………… (16)

六、连续函数的性质 …………… (18)

常考题型及其解题方法与技巧 …………… (19)

题型训练 …………… (32)

第二章 一元函数的导数与微分概念

及其计算 …………… (35)

知识结构网络图 …………… (35)

内容概要与重难点提示 …………… (35)

考核知识要点讲解 …………… (36)

一、一元函数的导数与微分 …………… (36)

二、按定义求导数及其适用的情
形 …………… (39)

三、基本初等函数导数表, 导数四则
运算法则与复合函数微分法则
…………… (41)

四、初等函数的求导法 …………… (42)

五、复合函数求导法的应用——由
复合函数求导法则导出的几类

函数的微分法 …………… (43)

六、分段函数的求导法 …………… (46)

七、高阶导数及 n 阶导数的求法 …………… (48)

八、一元函数微分学的简单应用 …………… (50)

常考题型及其解题方法与技巧 …………… (51)

题型训练 …………… (61)

第三章 一元函数积分概念、计算及

应用…………… (63)

知识结构网络图 …………… (63)

内容概要与重难点提示 …………… (64)

考核知识要点讲解 …………… (64)

一、一元函数积分的概念、性质与基
本定理 …………… (64)

二、基本积分表与积分法则 …………… (70)

三、几种特殊类型函数的积分法 …………… (81)

四、积分计算技巧 …………… (84)

五、反常积分 (广义积分) …………… (85)

六、积分学应用的基本方法——微元
分析法 …………… (88)

七、一元函数积分学的几何应用 …………… (89)

八、一元函数积分学的物理应用 …………… (95)

常考题型及其解题方法与技巧 …………… (98)

题型训练 …………… (121)

第四章 微分中值定理及其应用…………… (125)

知识结构网络图 …………… (125)

内容概要与重难点提示 …………… (125)

考核知识要点讲解 …………… (126)

一、微分中值定理及其作用 …………… (126)

二、利用导数研究函数的性态 …………… (127)

三、一元函数的最大值与最小值问题
…………… (133)

常考题型及其解题方法与技巧	(135)	三、向量的运算	(196)
题型训练	(156)	四、平面方程、直线方程	(199)
第五章 一元函数的泰勒公式及其		五、平面、直线之间相互关系与	
应用	(160)	距离公式	(201)
知识结构网络图	(160)	六、旋转面与柱面方程, 常用二次曲	
内容概要与重难点提示	(160)	面的方程及其图形	(203)
考核知识要点讲解	(160)	七、空间曲线在坐标平面上的投影	
一、带皮亚诺余项与拉格朗日余项的			(204)
n 阶泰勒公式	(160)	常考题型及其解题方法与技巧	(204)
二、泰勒公式的求法	(162)	题型训练	(211)
三、泰勒公式的若干应用	(163)	第八章 多元函数微分学	(213)
常考题型及其解题方法与技巧	(167)	知识结构网络图	(213)
题型训练	(171)	内容概要与重难点提示	(213)
第六章 常微分方程	(172)	考核知识要点讲解	(214)
知识结构网络图	(172)	一、多元函数的概念、极限与连续性	
内容概要与重难点提示	(172)		(214)
考核知识要点讲解	(173)	二、多元函数的偏导数与全微分	(216)
一、基本概念	(173)	三、多元函数的微分法则	(220)
二、一阶微分方程	(173)	四、复合函数求导法的应用——隐函	
三、可降阶的高阶方程	(176)	数微分法	(223)
四、含变限积分的方程	(177)	五、复合函数求导法则的其他应用	
五、线性微分方程解的性质与结构			(226)
	(178)	六、多元函数的极值问题	(227)
六、二阶和某些高阶常系数齐次线		七、多元函数的最大值与最小值问题	
性微分方程	(179)		(228)
七、二阶常系数非齐次线性微分方		八、方向导数与梯度	(231)
程与欧拉方程	(180)	九、多元函数微分学的几何应用	
八、微分方程的简单应用	(181)		(232)
常考题型及其解题方法与技巧	(185)	常考题型及其解题方法与技巧	(234)
题型训练	(191)	题型训练	(244)
第七章 向量代数和空间解析几何	(194)	第九章 多元函数积分的概念、计算及	
知识结构网络图	(194)	其应用	(248)
内容概要与重难点提示	(194)	知识结构网络图	(248)
考核知识要点讲解	(195)	内容概要与重难点提示	(248)
一、空间直角坐标系	(195)	考核知识要点讲解	(249)
二、向量的概念	(195)	一、多元函数积分的概念与性质	(249)

二、在直角坐标系中化多元函数的积

分为定积分 (253)

三、重积分的变量替换 (259)

四、如何应用多元函数积分的计算

公式及简化计算 (264)

五、多元函数积分学的几何应用 ... (274)

六、多元函数积分学的物理应用 ... (277)

常考题型及其解题方法与技巧 (279)

题型训练 (304)

第十章 多元函数积分学中的基本公

式及其应用 (307)

知识结构网络图 (307)

内容概要与重难点提示 (307)

考核知识要点讲解 (308)

一、多元函数积分学中的基本公式

——格林公式, 高斯公式与斯托克斯公式 (308)

二、向量场的通量与散度, 环流量与旋度 (310)

三、格林公式, 高斯公式与斯托克斯公式的一个应用

——简化多元函数积分的计算 (311)

四、平面上曲线积分与路径无关问题

及微分式的原函数问题 (316)

常考题型及其解题方法与技巧 (322)

题型训练 (331)

第十一章 无穷级数 (333)

知识结构网络图 (333)

内容概要与重难点提示 (333)

考核知识要点讲解 (334)

一、常数项级数 (334)

二、幂级数 (338)

三、傅里叶级数 (343)

常考题型及其解题方法与技巧 (346)

题型训练 (364)

第二篇 线性代数

第一章 行列式 (368)

知识结构网络图 (368)

内容概要与重难点提示 (368)

考核知识要点讲解 (369)

一、行列式的概念、展开公式及其性

质 (369)

二、有关行列式的几个重要公式 ... (373)

三、关于克莱姆 (Cramer) 法则 ... (373)

常考题型及其解题方法与技巧 (374)

题型训练 (385)

第二章 矩阵及其运算 (387)

知识结构网络图 (387)

内容概要与重难点提示 (387)

考核知识要点讲解 (388)

一、矩阵的概念及几类特殊方阵 ... (388)

二、矩阵的运算 (390)

三、矩阵可逆的充分必要条件 (392)

四、矩阵的初等变换与初等矩阵 ... (392)

五、矩阵的等价 (393)

常考题型及其解题方法与技巧 (394)

题型训练 (411)

第三章 n 维向量与向量空间 (414)

知识结构网络图 (414)

内容概要与重难点提示 (414)

考核知识要点讲解 (415)

一、 n 维向量的概念与运算 (415)

二、线性组合与线性表出 (415)

三、向量组的线性相关与线性无关

..... (416)

四、线性相关性与线性表出的关系

..... (417)

五、向量组的秩与矩阵的秩 (418)

六、矩阵秩的重要公式	(419)
七、向量空间、子空间与基、维数、 坐标	(419)
八、基变换与坐标变换	(420)
九、规范正交基与 Schmidt 正交化	(421)
常考题型及其解题方法与技巧	(421)
题型训练	(444)

第四章 线性方程组

知识结构网络图	(447)
内容概要与重难点提示	(447)
考核知识要点讲解	(447)
一、线性方程组的各种表达形式及 相关概念	(447)
二、基础解系的概念及其求法	(448)
三、齐次方程组有非零解的判定	(448)
四、非齐次线性方程组有解的判定	(449)
五、非齐次线性方程组解的结构	(449)
六、线性方程组解的性质	(449)
常考题型及其解题方法与技巧	(450)
题型训练	(465)

第五章 矩阵的特征值与特征向量

知识结构网络图	(468)
内容概要与重难点提示	(468)
考核知识要点讲解	(469)
一、矩阵的特征值与特征向量的概 念、性质及求法	(469)
二、相似矩阵的概念与性质	(471)
三、矩阵可相似对角化的充分必要条 件及解题步骤	(472)
常考题型及其解题方法与技巧	(474)
题型训练	(493)

第六章 二次型

知识结构网络图	(496)
---------------	-------

内容概要与重难点提示	(496)
考核知识要点讲解	(497)
一、二次型的概念及其标准形	(497)
二、正定二次型与正定矩阵	(498)
三、合同矩阵	(499)
常考题型及其解题方法与技巧	(499)
题型训练	(512)

第三篇 概率论与数理统计

第一章 随机事件和概率

知识结构网络图	(514)
内容概要与重难点提示	(514)
考核知识要点讲解	(515)
一、随机事件的关系与运算	(515)
二、随机事件的概率	(517)
三、事件的独立性与独立重复试验	(521)
常考题型及其解题方法与技巧	(523)
题型训练	(530)

第二章 随机变量及其分布

知识结构网络图	(532)
内容概要与重难点提示	(532)
考核知识要点讲解	(533)
一、随机变量及其分布函数	(533)
二、离散型随机变量与连续型随机变 量	(534)
三、常见的离散型、连续型随机变量 及其概率分布	(537)
四、随机变量函数的分布	(541)
常考题型及其解题方法与技巧	(544)
题型训练	(553)

第三章 多维随机变量及其分布

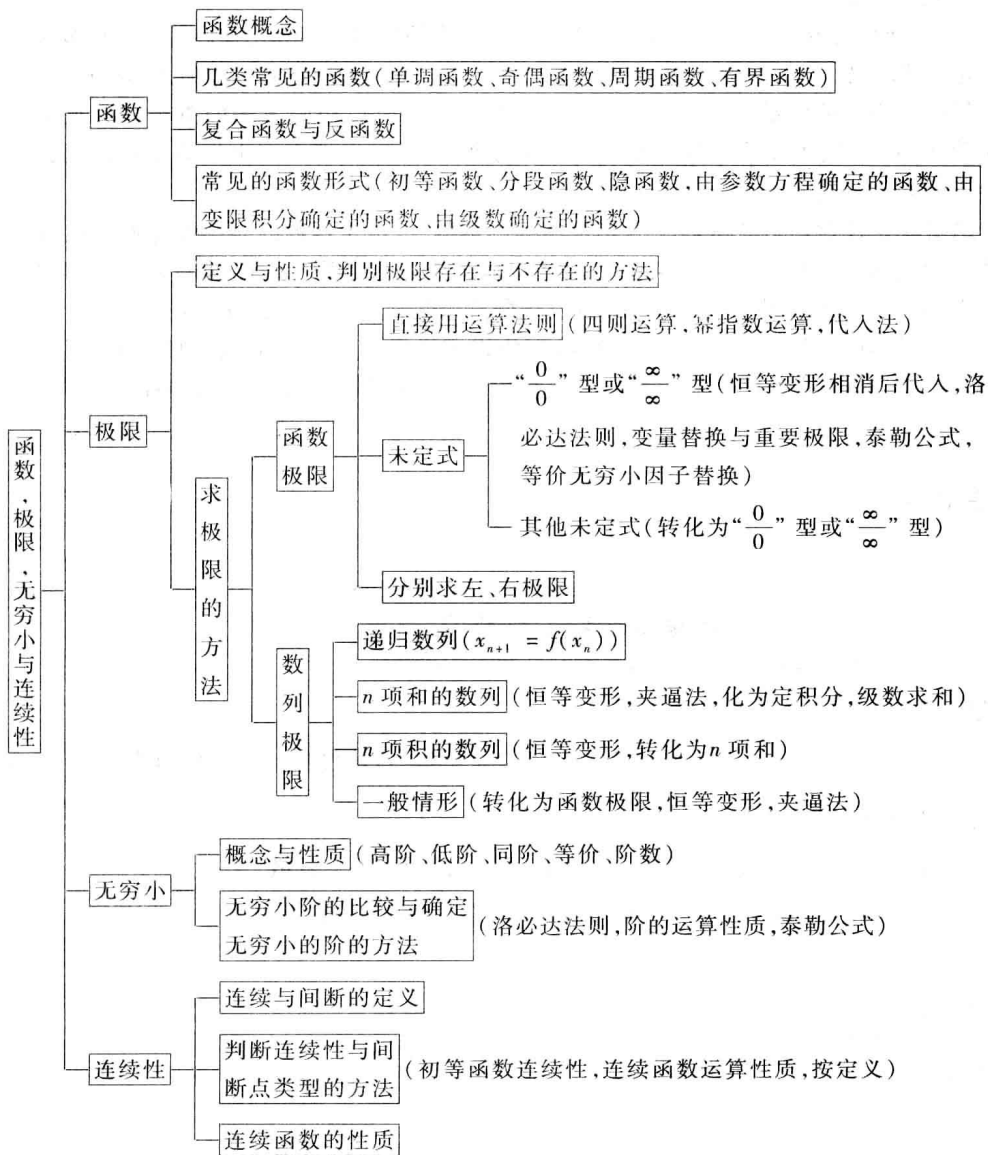
知识结构网络图	(556)
内容概要与重难点提示	(556)

考核知识要点讲解	(557)	考核知识要点讲解	(603)
一、二维随机变量的联合分布函数与 边缘分布函数	(557)	一、大数定律	(603)
二、二维离散型随机变量	(558)	二、中心极限定理	(605)
三、二维连续型随机变量	(560)	常考题型及其解题方法与技巧	(605)
四、二维随机变量的独立性	(563)	题型训练	(609)
五、两个常见的二维连续型随机变量 的分布	(564)	第六章 数理统计的基本概念	(611)
六、两个随机变量函数的分布	(566)	知识结构网络图	(611)
常考题型及其解题方法与技巧	(572)	内容概要与重难点提示	(611)
题型训练	(581)	考核知识要点讲解	(611)
第四章 随机变量的数字特征	(584)	一、总体与样本	(611)
知识结构网络图	(584)	二、统计量	(613)
内容概要与重难点提示	(584)	三、抽样分布	(613)
考核知识要点讲解	(584)	常考题型及其解题方法与技巧	(617)
一、随机变量的数学期望和方差	(584)	题型训练	(621)
二、协方差与相关系数	(588)	第七章 参数估计和假设检验	(623)
三、随机变量的矩	(590)	知识结构网络图	(623)
常考题型及其解题方法与技巧	(591)	内容概要与重难点提示	(623)
题型训练	(601)	考核知识要点讲解	(624)
第五章 大数定律和中心极限定理	(603)	一、参数估计	(624)
知识结构网络图	(603)	二、假设检验	(628)
内容概要与重难点提示	(603)	常考题型及其解题方法与技巧	(630)
		题型训练	(635)

第一篇 高等数学

第一章 极限、连续与求极限的方法

知识结构网络图



内容概要与重难点提示

(一) 微积分中研究的对象是函数 函数概念的实质是变量之间确定的对应关系, 变量之间是否

有函数关系,就看是否存在一种对应规则,使得其中一个量或几个量定了,另一个量也就被唯一确定,前者是一元函数,后者是多元函数.

函数这部分的重点是:复合函数、反函数和分段函数、函数记号的运算、基本初等函数与其图象、初等函数的概念等.

(二) 极限是微积分的理论基础 研究函数的性质实质上是研究各种类型的极限,如连续、导数、定积分、级数等等.由此可见极限的重要性.本章的重点内容是极限.既要准确理解极限的概念、性质和极限存在的条件,又要能准确地求出各种极限.求极限的方法很多,综合起来主要有:

- ① 利用极限的四则运算与幂指数运算法则; ② 利用函数的连续性;
- ③ 利用变量替换与两个重要极限; ④ 利用等价无穷小因子替换;
- ⑤ 利用洛必达法则; ⑥ 分别求左、右极限;
- ⑦ 数列极限转化为函数极限; ⑧ 利用适当放大缩小法;
- ⑨ 对递归数列先证明极限存在(常用到“单调有界数列有极限”的准则),再利用递归关系求出极限;
- ⑩ 利用导数的定义求极限; ⑪ 利用泰勒公式; ⑫ 利用定积分求 n 项和式的极限.

(三) 无穷小就是极限为零的变量 极限问题可归结为无穷小问题.极限方法的重要部分是无穷小分析,或说无穷小阶的估计与分析.要理解无穷小及其阶的概念,学会比较无穷小的阶及确定无穷小阶的方法,会用等价无穷小因子替换求极限.

(四) 我们研究的对象是连续函数或除若干点外是连续的函数 由于函数的连续性是通过极限定义的,所以判断函数是否连续及函数间断点的类型等问题本质上仍是求极限.因此这部分也是本章的重点.要掌握判断函数连续性及间断点类型的方法,特别是分段函数在分界点处的连续性.

(五) 有界闭区间上连续函数的基本性质 函数的其他许多性质都与函数的连续性有关,因此我们要了解有界闭区间上连续函数的重要性质,包括:有界性定理,最大值、最小值定理和中间值(介值)定理,并会应用这些性质.

考核知识要点讲解

一、极限的概念与性质

(一) 极限的定义

【定义 1.1】(数列的极限) $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = A \Leftrightarrow \forall \varepsilon > 0, \exists$ 正整数 N ,使得当 $n > N$ 时就有

$$|x_n - A| < \varepsilon.$$

若数列 $\{x_n\}$ 存在极限(有限数),又称数列 $\{x_n\}$ 收敛,否则称数列 $\{x_n\}$ 发散.

【定义 1.2】(函数的极限) $\lim_{x \rightarrow \infty} f(x) = A \Leftrightarrow \forall \varepsilon > 0, \exists$ 正数 X ,使得当 $|x| > X$ 时就有

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

类似可定义单侧极限 $\lim_{x \rightarrow +\infty} f(x) = A$ 与 $\lim_{x \rightarrow -\infty} f(x) = A$.

【注】 在函数极限情形下 $x \rightarrow \infty$ 与数列极限中 $n \rightarrow \infty$ 的意义不同,前者是指 $x \rightarrow \pm \infty$,而后者是指 $n \rightarrow +\infty$.

【定义 1.3】(函数的极限) $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A \Leftrightarrow \forall \varepsilon > 0, \exists$ 正数 δ ,使得当 $0 < |x - x_0| < \delta$ 时有

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

类似可定义 $f(x)$ 当 $x \rightarrow x_0$ 时左极限 $f(x_0 - 0)$ 与右极限 $f(x_0 + 0)$:

$$f(x_0 - 0) = \lim_{x \rightarrow x_0 - 0} f(x) = A, \quad f(x_0 + 0) = \lim_{x \rightarrow x_0 + 0} f(x) = A.$$

(二) 极限的基本性质

►1. 数列极限的基本性质

【定理 1.1】(极限的不等式性质) 设 $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = a$, $\lim_{n \rightarrow \infty} y_n = b$.

(1) 若 $a > b$, 则 $\exists N$, 当 $n > N$ 时有 $x_n > y_n$; (2) 若 $n > N$ 时 $x_n \geq y_n$, 则 $a \geq b$.

【定理 1.2】(收敛数列的有界性) 设数列 $\{x_n\}$ 收敛, 则数列 $\{x_n\}$ 有界 (即 $\exists$ 常数 $M > 0$, $|x_n| \leq M$, $n = 1, 2, \dots$).

►2. 函数极限的基本性质

【定理 1.3】(极限的不等式性质) 设 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$, $\lim_{x \rightarrow x_0} g(x) = B$.

(1) 若 $A > B$, 则 $\exists \delta > 0$ 使得当 $0 < |x - x_0| < \delta$ 时有 $f(x) > g(x)$;

(2) 若 $\exists \delta > 0$, 使得当 $0 < |x - x_0| < \delta$ 时有 $f(x) \geq g(x)$, 则 $A \geq B$.

【推论】(极限的保号性) 设 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$.

(1) 若 $A > 0$, 则 $\exists \delta > 0$ 使得当 $0 < |x - x_0| < \delta$ 时有 $f(x) > 0$;

(2) 若 $\exists \delta > 0$, 使得当 $0 < |x - x_0| < \delta$ 时有 $f(x) \geq 0$, 则 $A \geq 0$.

【注】 若(2)中的条件“ $f(x) \geq 0$ ”改为“ $f(x) > 0$ ”, 其他条件保持不变, 则结论仍是“ $A \geq 0$ ”.

【定理 1.4】(存在极限的函数局部有界性) 设存在极限 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$, 则 $f(x)$ 在 x_0 的某空心邻域 $U_0(x_0, \delta) = \{x | 0 < |x - x_0| < \delta\}$ 内有界, 即 $\exists \delta > 0$ 与 $M > 0$, 使得当 $0 < |x - x_0| < \delta$ 时有 $|f(x)| \leq M$.

【注】 其他极限过程如 $x \rightarrow x_0 + 0, x \rightarrow x_0 - 0, x \rightarrow +\infty, x \rightarrow -\infty$ 等也有类似的结论.

(三) 两个重要极限

$$\lim_{x \rightarrow 0} \frac{\sin x}{x} = 1, \quad \lim_{x \rightarrow \infty} \left(1 + \frac{1}{x}\right)^x = e \text{ 或 } \lim_{x \rightarrow 0} (1+x)^{\frac{1}{x}} = e, \quad \lim_{x \rightarrow 0} \frac{\ln(1+x)}{x} = 1 \quad (1.1)$$

【例 1.1】 判断下列结论是否正确, 并证明你的判断.

(I) 若 $x_n < y_n (n > N)$, 且存在极限 $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = A$, $\lim_{n \rightarrow \infty} y_n = B$, 则 $A < B$;

(II) 设 $f(x)$ 在 (a, b) 有定义, 又 $\exists c \in (a, b)$ 使得极限 $\lim_{x \rightarrow c} f(x) = A$, 则 $f(x)$ 在 (a, b) 有界;

(III) 若 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = \infty$, 则 $\exists \delta > 0$ 使得当 $0 < |x - a| < \delta$ 时 $\frac{1}{f(x)}$ 有界.

【解】 (I) 不正确. 在题设下只能保证 $A \leq B$, 不能保证 $A < B$. 例如, $x_n = \frac{1}{n}, y_n = \frac{2}{n}$, 则 $x_n < y_n$, 而 $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = \lim_{n \rightarrow \infty} y_n = 0$.

评注 若 $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n$ 与 $\lim_{n \rightarrow \infty} y_n$ 都存在, 则对不等式 $x_n < y_n (n > N)$ 两边当 $n \rightarrow \infty$ 时取极限, 除保持不等号外还应加上等号, 即 $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n \leq \lim_{n \rightarrow \infty} y_n$.

(II) 不正确. 这时只能保证: $\exists$ 点 c 的一个空心邻域 $U_0(c, \delta) = \{x | 0 < |x - c| < \delta\}$ 使 $f(x)$ 在 $U_0(c, \delta)$ 中有界, 一般不能保证 $f(x)$ 在 (a, b) 有界. 例如: $f(x) = \frac{1}{x}$, $(a, b) = (0, 1)$, 取定 $c \in (0, 1)$,

1), 则 $\lim_{x \rightarrow c} f(x) = \frac{1}{c}$, 但 $f(x) = \frac{1}{x}$ 在 $(0, 1)$ 无界.

(Ⅲ) 正确. 因为 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = \infty \Rightarrow \lim_{x \rightarrow a} \frac{1}{f(x)} = 0$, 由存在极限的函数的局部有界性 $\Rightarrow \exists \delta > 0$ 使得

当 $0 < |x - a| < \delta$ 时 $\frac{1}{f(x)}$ 有界.

二、极限存在性的判别(极限存在的两个准则)

(一) 夹逼定理

【定理 1.5】(数列情形) 若 $\exists N$, 使得当 $n > N$ 时有 $y_n \leq x_n \leq z_n$, 且 $\lim_{n \rightarrow \infty} y_n = \lim_{n \rightarrow \infty} z_n = a$, 则

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = a.$$

【定理 1.6】(函数情形) 若 $\exists \delta > 0$, 使得当 $0 < |x - x_0| < \delta$ 时有 $h(x) \leq f(x) \leq g(x)$, 又 $\lim_{x \rightarrow x_0} h(x) = \lim_{x \rightarrow x_0} g(x) = A$, 则 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$.

【注】其他极限过程也有类似的结论.

(二) 单调有界数列必收敛定理

【定理 1.7】若数列 $\{x_n\}$ 单调上升有上界, 即 $x_{n+1} \geq x_n$ ($n = 1, 2, \dots$), 并存在一个数 M 使得对一切的 n 有 $x_n \leq M$, 则 $\{x_n\}$ 收敛. 即存在一个数 a , 使得 $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = a$, 且有 $x_n \leq a$ ($n = 1, 2, \dots$).

若数列 $\{x_n\}$ 单调下降有下界, 即 $x_{n+1} \leq x_n$ ($n = 1, 2, \dots$), 并存在一个数 m 使得对一切的 n 有 $x_n \geq m$, 则 $\{x_n\}$ 收敛. 即存在一个数 a , 使得 $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = a$, 且有 $x_n \geq a$ ($n = 1, 2, \dots$).

(三) 极限存在的充要条件

【定理 1.8】(函数极限存在的充要条件) $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A \Leftrightarrow \lim_{x \rightarrow x_0^+} f(x) = \lim_{x \rightarrow x_0^-} f(x) = A$.

对于分段函数 $f(x) = \begin{cases} g(x), & x_0 - \delta < x < x_0, \\ h(x), & x_0 < x < x_0 + \delta, \end{cases}$ 考察 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x)$ 是否存在就需要分别求

$\lim_{x \rightarrow x_0^+} f(x) = \lim_{x \rightarrow x_0^+} h(x)$ 与 $\lim_{x \rightarrow x_0^-} f(x) = \lim_{x \rightarrow x_0^-} g(x)$, 并确定二者是否相等.

【定理 1.9】(数列极限存在的充要条件) $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = A \Leftrightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} x_{2n} = \lim_{n \rightarrow \infty} x_{2n-1} = A$.

【例 1.2】设 $f(x) = \begin{cases} 2(x+1)\arctan \frac{1}{x}, & x > 0, \\ 1, & x = 0, \\ \frac{\ln(1+ax^2)}{x \sin x}, & x < 0, \end{cases}$ 又 $a \neq 0$, 问 a 为何值时 $\lim_{x \rightarrow 0} f(x)$ 存在.

【分析】分别求右、左极限 $f(0+0)$ 与 $f(0-0)$, 由 $f(0+0) = f(0-0)$ 定出 a 值.

【解】 $f(0+0) = \lim_{x \rightarrow 0^+} f(x) = \lim_{x \rightarrow 0^+} 2(x+1)\arctan \frac{1}{x} = 2 \lim_{x \rightarrow 0^+} \arctan \frac{1}{x} = \pi$,

$$f(0-0) = \lim_{x \rightarrow 0-} f(x) = \lim_{x \rightarrow 0-} \left[\frac{\ln(1+ax^2)}{ax^2} \cdot \frac{ax^2}{x \sin x} \right] = 1 \cdot a \cdot 1 = a (a \neq 0),$$

由 $f(0+0) = f(0-0)$, 得 $a = \pi$. 因此, 当且仅当 $a = \pi$ 时, 存在 $\lim_{x \rightarrow 0} f(x) = \pi$.

评注 注意在本题中当 $a = \pi$ 时极限 $\lim_{x \rightarrow 0} f(x) = \pi$, 即当 $x \rightarrow 0$ 时 $f(x)$ 的极限存在, 但此极限值与函数值 $f(0) = 1$ 并不相等, 其原因在于 $\lim_{x \rightarrow 0} f(x)$ 描述的是当 $x \rightarrow 0$ 但 $x \neq 0$ 时 $f(x)$ 的变化趋势, 它与函数 $f(x)$ 在点 $x = 0$ 处的函数值 $f(0)$ 是多少没有关系.

【例 1.3】 $\lim_{x \rightarrow 1} (x-1)^2 e^{\frac{1}{x-1}} =$

(A) 0. (B) $-\infty$. (C) $+\infty$. (D) 不存在但也不是 ∞ .

【分析】 因为 $\lim_{t \rightarrow +\infty} e^t = +\infty$, $\lim_{t \rightarrow -\infty} e^t = 0$, 故要分别考察左、右极限. 由于

$$\lim_{x \rightarrow 1+0} (x-1)^2 e^{\frac{1}{x-1}} \stackrel{t = \frac{1}{x-1}}{=} \lim_{t \rightarrow +\infty} \frac{e^t}{t^2} = +\infty, \quad \lim_{x \rightarrow 1-0} (x-1)^2 e^{\frac{1}{x-1}} \stackrel{t = \frac{1}{x-1}}{=} \lim_{t \rightarrow -\infty} \frac{e^t}{t^2} = 0,$$

因此应选 (D).

(四) 证明函数 $f(x)$ 的极限不存在常用的方法

方法 1° 若 $f(x_0+0) \neq f(x_0-0)$, 则 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x)$ 不存在. 当 $x \rightarrow \infty$ 时, 对含有 $a^x (a > 0, a \neq 1)$ 或 $\arctan x$ 或 $\operatorname{arccot} x$ 的函数极限, 一定要对 $x \rightarrow +\infty$ 与 $x \rightarrow -\infty$ 分别求极限. 若两者的极限值相等, 则 $x \rightarrow \infty$ 时极限存在, 否则不存在.

方法 2° 若 $\exists x_n \rightarrow x_0$, 但 $x_n \neq x_0$ 的数列 $\{x_n\}$, 使得 $\lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n)$ 不存在或有两个满足 $x_n \rightarrow x_0 (x_n \neq x_0)$, $y_n \rightarrow x_0 (y_n \neq x_0)$ 的数列 $\{x_n\}$ 与 $\{y_n\}$ 使得 $\lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) \neq \lim_{n \rightarrow \infty} f(y_n)$, 则 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x)$ 不存在.

方法 3° 利用结论: 设 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = A$, $\lim_{x \rightarrow x_0} g(x)$ 不存在, 则 $\lim_{x \rightarrow x_0} [f(x) + g(x)]$ 不存在; 若又有 $A \neq 0$, 则 $\lim_{x \rightarrow x_0} [f(x) \cdot g(x)]$ 不存在.

【例 1.4】 证明: (I) $\lim_{x \rightarrow 0} \sin \frac{1}{x}$ 不存在; (II) 设 $f(x) = \frac{\int_0^x \sin \frac{1}{t} \cos t^2 dt}{x}$, 则 $\lim_{x \rightarrow 0} f(x)$ 不存在.

【证明】 (I) 取 $x_n = \frac{1}{2n\pi}$, $y_n = \frac{1}{2n\pi + \frac{\pi}{2}}$, 则均有 $x_n \rightarrow 0, y_n \rightarrow 0 (n \rightarrow \infty)$, 但

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sin \frac{1}{x_n} = 0, \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \sin \frac{1}{y_n} = 1, \text{ 因此 } \lim_{x \rightarrow 0} \sin \frac{1}{x} \text{ 不存在.}$$

评注 类似可证: $\lim_{x \rightarrow 0} \cos \frac{1}{x}$ 不存在.

(II) 已知 $f(x) = \frac{g(x)}{x} \cdot \sin \frac{1}{x}$, 其中 $g(x) = \int_0^x \cos t^2 dt$, 由于

$$\lim_{x \rightarrow 0} \frac{g(x)}{x} \stackrel{\text{洛必达法则}}{=} \lim_{x \rightarrow 0} \cos x^2 = 1 \neq 0,$$

而 $\lim_{x \rightarrow 0} \sin \frac{1}{x}$ 不存在, 所以 $\lim_{x \rightarrow 0} f(x) = \lim_{x \rightarrow 0} \frac{g(x)}{x} \sin \frac{1}{x}$ 不存在.

评注 这里用到了变限积分的求导公式: 设 $f(x)$ 在 $[a, b]$ 上连续, 则对任意 $x \in [a, b]$, 有

$$\left[\int_a^x f(t) dt \right]' = f(x).$$

三、求极限的方法

(一) 利用极限的四则运算法则与幂指数运算法则求极限

► 1. 极限的四则运算法则及其推广

【定理 1.10】(四则运算法则) 设 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = A$, $\lim_{x \rightarrow a} g(x) = B$, 则

$$\lim_{x \rightarrow a} [f(x) \pm g(x)] = A \pm B, \quad \lim_{x \rightarrow a} [f(x) \cdot g(x)] = A \cdot B, \quad \lim_{x \rightarrow a} \frac{f(x)}{g(x)} = \frac{A}{B} (B \neq 0).$$

四则运算法则的推广:

(1) 设 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = 0$, 且当 $0 < |x - a| < \delta$ 时 $g(x)$ 有界, 则 $\lim_{x \rightarrow a} [f(x)g(x)] = 0$.

(2) 设 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = \infty (+\infty, -\infty)$, 且当 $0 < |x - a| < \delta$ 时 $g(x)$ 有界或 $\lim_{x \rightarrow a} g(x) = A$, 则

$$\lim_{x \rightarrow a} [f(x) + g(x)] = \infty (+\infty, -\infty).$$

(3) 设 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = \infty (+\infty)$, 且当 $0 < |x - a| < \delta$ 时 $|g(x)| \geq A > 0 (g(x) \geq A > 0)$, 或

$$\lim_{x \rightarrow a} g(x) = A \neq 0 (A > 0), \text{ 或 } \lim_{x \rightarrow a} g(x) = \infty (+\infty), \text{ 则 } \lim_{x \rightarrow a} [f(x)g(x)] = \infty (+\infty).$$

(4) 设 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = \infty$, $\lim_{x \rightarrow a} g(x) = \infty$, 又当 $0 < |x - a| < \delta$ 时 $f(x)g(x) > 0$, 则

$$\lim_{x \rightarrow a} [f(x) + g(x)] = \infty.$$

【注】若 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = A$, $\lim_{x \rightarrow a} g(x)$ 不存在也不为 ∞ , 则 $\lim_{x \rightarrow a} [f(x) \pm g(x)]$ 不存在也不为 ∞ ; 若又有

$A \neq 0$, 则 $\lim_{x \rightarrow a} f(x)g(x)$, $\lim_{x \rightarrow a} \frac{g(x)}{f(x)}$ 均不存在也不为 ∞ . 但是, 当 $\lim_{x \rightarrow a} f(x)$ 与 $\lim_{x \rightarrow a} g(x)$ 都不存在且不为 ∞

时, 求 $f(x) \pm g(x)$, $f(x)g(x)$, $\frac{g(x)}{f(x)}$ 的极限则必须作具体分析.

► 2. 幂指数函数的极限运算法则及其推广

【定理 1.11】(幂指数运算法则) 设 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = A > 0$, $\lim_{x \rightarrow a} g(x) = B$, 则 $\lim_{x \rightarrow a} f(x)^{g(x)} = A^B (A > 0)$.

幂指数运算法则的推广:

(1) 设 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = A (A > 0, \text{ 且 } A \neq 1)$, $\lim_{x \rightarrow a} g(x) = +\infty$, 则 $\lim_{x \rightarrow a} f(x)^{g(x)} = \begin{cases} 0, & 0 < A < 1, \\ +\infty, & A > 1. \end{cases}$

(2) 设 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = 0$, $f(x) > 0 (0 < |x - a| < \delta)$, $\lim_{x \rightarrow a} g(x) = B \neq 0$, 则

$$\lim_{x \rightarrow a} f(x)^{g(x)} = \begin{cases} 0, & B > 0, \\ +\infty, & B < 0. \end{cases}$$

(3) 设 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = +\infty$, $\lim_{x \rightarrow a} g(x) = A \neq 0$, 则 $\lim_{x \rightarrow a} f(x)^{g(x)} = \begin{cases} +\infty, & A > 0, \\ 0, & A < 0. \end{cases}$

► 3. 对 $\frac{0}{0}$, $\frac{\infty}{\infty}$, $0 \cdot \infty$, $\infty - \infty$, 0^0 , 1^∞ , ∞^0 等各类未定式不能直接用上述运算法则.

最基本的是 $\frac{0}{0}$ 与 $\frac{\infty}{\infty}$ 型, 其他类型应经恒等变形转化为 $\frac{0}{0}$ 或 $\frac{\infty}{\infty}$ 型未定式.

求 $\frac{0}{0}$ 或 $\frac{\infty}{\infty}$ 型极限的方法有多种(参看题型一), 其中一种重要技巧是设法消去分子、分母中的极

限为零或 ∞ 因子,于是转化为可以直接用四则运算法则的情形(后面还要介绍其他方法,如洛必达法则).

【例 1.5】 求 $w = \lim_{x \rightarrow +\infty} \frac{xe^x(2e^x + 1)}{[1 + (e^x + 1)^2](1 + e^x)}$.

【解】 这是求 $\frac{\infty}{\infty}$ 型极限,用相除法,分子、分母同除以 $(e^x)^2$ 得

$$w = \lim_{x \rightarrow +\infty} \frac{x}{e^x + 1} \cdot \frac{2 + e^{-x}}{e^{-2x} + (1 + e^{-x})^2} = 0 \times 2 = 0,$$

其中 $\lim_{x \rightarrow +\infty} \frac{x}{e^x + 1} = 0$ (用洛必达法则).

(二) 利用函数的连续性求极限

1. 设 $f(x)$ 在 $x = a$ 连续,按定义就有 $\lim_{x \rightarrow a} f(x) = f(a)$. 因此对连续函数求极限就是用代入法求函数值.

2. 一切初等函数在其定义域区间上连续. 因此,若 $f(x)$ 是初等函数,且 a 属于其定义域,则

$$\lim_{x \rightarrow a} f(x) = f(a).$$

3. 设 $\lim_{x \rightarrow a} g(x) = A$,若补充定义 $g(a) = A$,则 $g(x)$ 在 $x = a$ 连续. 若又有 $y = f(u)$ 在 $u = A$ 处连续,则由复合函数的连续性得 $\lim_{x \rightarrow a} f[g(x)] = f[\lim_{x \rightarrow a} g(x)] = f(A)$.

(三) 利用变量替换法与两个重要极限求极限

通过变量替换,把求某个极限转化为求另一个极限,若后者能算得出来,问题就解决了.

1. 设 $\lim_{x \rightarrow +\infty} \varphi(x) = +\infty$ 且 $\lim_{u \rightarrow +\infty} f(u) = A$,则 $\lim_{x \rightarrow +\infty} f[\varphi(x)] \xrightarrow{u = \varphi(x)} \lim_{u \rightarrow +\infty} f(u) = A$.

(若把 $x \rightarrow +\infty$ 改为 $x \rightarrow -\infty$ 或 $x \rightarrow x_0$ 上述结论仍成立.)

2. 设 $\lim_{x \rightarrow x_0} \varphi(x) = u_0$ 且 $f(u)$ 在 u_0 连续,则 $\lim_{x \rightarrow x_0} f[\varphi(x)] \xrightarrow[\substack{x \rightarrow x_0 \text{ 时} \\ u \rightarrow u_0}]{u = \varphi(x)} \lim_{u \rightarrow u_0} f(u) = f(u_0)$.

重要极限与变量替换法相结合可求下列极限:

(1) 诸如:

$$\lim_{x \rightarrow x_0} \frac{\sin \varphi(x)}{\varphi(x)} = 1, \quad \lim_{x \rightarrow x_0} [1 + \varphi(x)]^{\frac{1}{\varphi(x)}} = e, \quad \lim_{x \rightarrow x_0} \frac{\ln[1 + \varphi(x)]}{\varphi(x)} = 1,$$

$$\lim_{x \rightarrow x_0} [1 + \varphi(x)]^{\frac{\psi(x)}{\varphi(x)}} = \lim_{x \rightarrow x_0} \left([1 + \varphi(x)]^{\frac{1}{\varphi(x)}} \right)^{\psi(x)} = e^A,$$

其中 $\lim_{x \rightarrow x_0} \varphi(x) = 0, \lim_{x \rightarrow x_0} \psi(x) = A$.

(2) 设 $\lim_{x \rightarrow x_0} f(x) = 1, \lim_{x \rightarrow x_0} g(x) = \infty$, 则求 1^∞ 型极限

$$\lim_{x \rightarrow x_0} f(x)^{g(x)} = \lim_{x \rightarrow x_0} \left\{ [1 + (f(x) - 1)]^{\frac{1}{f(x) - 1}} \right\}^{g(x)[f(x) - 1]} = e^A,$$

转化为求 $0 \cdot \infty$ 型极限 $\lim_{x \rightarrow x_0} g(x)[f(x) - 1] = A$.

【注】 上述极限过程 $x \rightarrow x_0$ 改为其他情形也有类似结论.