

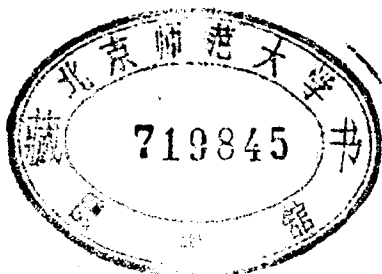
数学分析原理

下 册

[美] W. 卢 丁 著
赵慈庚 蒋 铎 译

591.0110

017/17



人民教育出版社

本书是根据 W. Rudin 所著《Principles of Mathematical Analysis》一书 1976 年第三版译出的。原书是为数学专业的高年级大学生和一年级研究生写的数学分析教本。译本分上、下册出版。

下册包括原书七至十一章，内容为函数序列与函数项级数、特殊函数、多元函数、微分形式的积分、Lebesgue 理论。

本书可供数学专业高年级学生、研究生和教师参考。

高等学校教学参考书
数学分析原理
下 册

[美] W. 卢 丁著
赵慈庚 蒋 铎译

人民教育出版社出版
新华书店北京发行所发行
人民教育出版社印刷厂印装

开本 787×1092 1/32 印张 7 字数 170,000

1979 年 11 月第 1 版 1980 年 6 月第 1 次印刷

印数 00,001—18,200

书号 13012·0398 定价 0.52 元

重要符号表

下表所列符号附以简短说明及其定义所在之页数。

上 册			
\in 属于	3	\bigcap, \bigcap 交	30
\notin 不属于	3	(a, b) 开区间	34
\subset, \supset 包含符号	3	$[a, b]$ 闭区间	34
\mathbb{Q} 有理数域	3	E^c E 的余集	35
$<, \leq, >, \geq$ 不等符号	3	E' E 的极限点的集	39
sup 最小上界	4	\bar{E} E 的闭包	39
inf 最大下界	4	lim 极限	54
\mathbb{R} 实数域	9	\rightarrow 收敛于	54, 109
$+\infty, -\infty, \infty$ 无穷大	13, 30	lim sup 上极限	63
\bar{z} 复共轭	15	lim inf 下极限	63
Re(z) 实部	15	$g \circ f$ 复合	96
Im(z) 虚部	15	$f(x+)$ 右极限	105
$ z $ 绝对值	16	$f(x-)$ 左极限	105
Σ 求和符号	17, 66	$f', f'(x)$ 导数	115, 125
\mathbb{R}^k k 维欧氏空间	17	$U(P, f), U(P, f, \alpha), L(P, f),$	
$\mathbf{0}$ 零向量	18	$L(P, f, \alpha)$ Riemann 和	134, 136
$x \cdot y$ 内积	18	$\mathcal{R}, \mathcal{R}(\alpha)$ Riemann(Stieltjes)	
$ x $ 向量 x 的模	18	可积函数类	135, 136
$\{x_n\}$ 序列	29	$\ \ $ 范数	157
\bigcup, \bigcup 并	30		
下 册			
$\mathcal{C}(X)$ 连续函数空间	9	$\ \ $ 范数	9, 207

exp 指数函数	41	\wedge 乘号	127
D_N Dirichlet 核	52	d 微分算子	135
$\Gamma(x)$ Γ 函数	56	ω_T ω 的变换	138
$\{e_1, \dots, e_n\}$ 标准基	70	∂ 边缘算子	145
$L(X), L(X, Y)$ 线性变换空间	73	$\nabla \times F$ 旋度	159
$[A]$ 矩阵	75	$\nabla \cdot F$ 散度	159
$D_j f$ 偏导数	82	\mathcal{C} 初等集的环	182
∇f 梯度	84	m Lebesgue 测度	182, 189
$\mathcal{C}^1, \mathcal{C}^k$ 可微函数类	86, 106	μ 测度	183, 189
$\det[A]$ 行列式	102	$\mathfrak{M}_F, \mathfrak{M}$ 可测集类	185
$J_f(x)$ 函数行列式	105	$\{x P\}$ 带有性质 P 的集	190
$\frac{\partial(y_1, \dots, y_n)}{\partial(x_1, \dots, x_n)}$ 函数行列式	105	f^+, f^- f 的正(负)部	192
I^k k -方格	117	K_E 特征函数	194
Q^k k -单形	119	$\mathcal{L}, \mathcal{L}(\mu), \mathcal{L}^2, \mathcal{L}^2(\mu)$ Lebesgue 可	
dx_i 基本 k -形式	131	积的函数类	195, 207

目 录

第七章 函数序列与函数项级数	1
主要问题的讨论.....	1
一致收敛性.....	5
一致收敛性与连续性.....	7
一致收敛性与积分.....	10
一致收敛性与微分.....	11
等度连续的函数族.....	14
Stone-Weierstrass 定理.....	18
习题.....	25
第八章 一些特殊函数	32
幂级数.....	32
指数函数与对数函数.....	39
三角函数.....	43
复数域的代数完备性.....	47
Fourier 级数.....	48
\checkmark 函数.....	56
习题.....	60
第九章 多元函数	69
线性变换.....	69
微分法.....	77
凝缩原理.....	87
反函数定理.....	89
隐函数定理.....	92
秩定理.....	97
行列式.....	102
高阶导数.....	106
积分的微分法.....	107

习题	110
第十章 微分形式的积分	117
积分	117
本原映射	120
单位的分割	123
变量代换	124
微分形式	126
单形与链	142
Stokes 定理	149
闭形式与恰当形式	152
向量分析	159
习题	167
第十一章 LEBESGUE 理论	179
集函数	179
Lebesgue 测度的建立	181
测度空间	190
可测函数	191
简单函数	193
积分	194
与 Riemann 积分的比较	203
复函数的积分	206
\mathcal{L}^2 类的函数	207
习题	214
参考书目	217

第七章 函数序列与函数项级数

虽然下面的多数定理以及它们的证明不难推广到向量值函数,甚至推广到映入一般度量空间之内的映射,但在这一章里,我们只限于讨论复值函数(自然,它包括实值函数).我们宁愿停止在这个简单范围之内,为的是把注意力集中在最重要的方面——调换两个极限过程时出现的若干问题.

主要问题的讨论

7.1 定义 假设 $n=1, 2, 3, \dots, \{f_n\}$ 是一个定义在集 E 上的函数序列,再假设数列 $\{f_n(x)\}$ 对于每个 $x \in E$ 收敛. 我们便可以由

$$(1) \quad f(x) = \lim_{n \rightarrow \infty} f_n(x) \quad (x \in E).$$

确定一个函数 f .

这时候,我们说 $\{f_n\}$ 在 E 上收敛,并且 f 是 $\{f_n\}$ 的极限或极限函数. 有时也用一个带一点描述性的术语,即:如果(1)成立,就说“在 E 上 $\{f_n\}$ 逐点收敛于 f ”. 类似地,如果对于每个 $x \in E, \sum f_n(x)$ 收敛,并且如果我们定义

$$(2) \quad f(x) = \sum_{n=1}^{\infty} f_n(x) \quad (x \in E),$$

便说函数 f 是级数 $\sum f_n$ 的和.

出现的主要问题是:在极限运算(1)与(2)之下,判断函数的一些重要性质是否能够保留下来. 例如,假如函数 f_n 都是连续的,或可微的,或可积的,这些性质对于极限函数是不是也成立? f'_n 与

f' 或 f_n 的积分与 f 的积分之间的关系是什么?

所谓 f 在 x 点连续, 即是说

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

因此, 问一个连续函数序列的极限是否连续, 就等同于问是否

$$(3) \quad \lim_{t \rightarrow x} \lim_{n \rightarrow \infty} f_n(t) = \lim_{n \rightarrow \infty} \lim_{t \rightarrow x} f_n(t),$$

换句话说, 执行这两个极限过程的次序是否无所谓. 在(3)式的左端, 我们先让 $n \rightarrow \infty$, 然后让 $t \rightarrow x$; 在右端, 先是 $t \rightarrow x$, 然后 $n \rightarrow \infty$.

现在, 我们用几个实例说明两个极限过程一般不能互相交换而不影响最后结果. 然后证明在某些条件下, 两个极限运算的次序是无所谓的.

第一个也是最简单的例子, 涉及一个“双重序列”.

7.2 例 $m=1, 2, 3, \dots, n=1, 2, 3, \dots$, 置

$$s_{m,n} = \frac{m}{m+n},$$

那么对于每个固定的 n ,

$$\lim_{m \rightarrow \infty} s_{m,n} = 1.$$

于是

$$(4) \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \lim_{m \rightarrow \infty} s_{m,n} = 1.$$

另一方面, 对于每个固定的 m ,

$$\lim_{n \rightarrow \infty} s_{m,n} = 0.$$

于是

$$(5) \quad \lim_{m \rightarrow \infty} \lim_{n \rightarrow \infty} s_{m,n} = 0.$$

7.3 例 设 x 是实数, $n=0, 1, 2, \dots$,

$$f_n(x) = \frac{x^2}{(1+x^2)^n},$$

试看

$$(6) \quad f(x) = \sum_{n=0}^{\infty} f_n(x) = \sum_{n=0}^{\infty} \frac{x^2}{(1+x^2)^n},$$

由于 $f_n(0) = 0$, 便应该 $f(0) = 0$. 当 $x \neq 0$ 时, (6) 式中最末的级数是收敛的几何级数, 以 $1+x^2$ 为和 (定理 3.26). 因此,

$$(7) \quad f(x) = \begin{cases} 0 & (x=0), \\ 1+x^2 & (x \neq 0). \end{cases}$$

所以, 连续函数的收敛级数可以有不连续的和.

7.4 例 $m=1, 2, 3, \dots$, 置

$$f_m(x) = \lim_{n \rightarrow \infty} (\cos m! \pi x)^{2n}.$$

当 $m!x$ 是整数时, $f_m(x) = 1$, 对于一切其他 x 值, $f_m(x) = 0$. 现在令

$$f(x) = \lim_{m \rightarrow \infty} f_m(x).$$

当 x 是无理数时, 对于每个 m 值, $f_m(x) = 0$, 因而 $f(x) = 0$; 当 x 是有理数时, 比如说 $x = \frac{p}{q}$, 这里 p 和 q 是整数; 这时如果 $m \geq q$, $m!x$ 便是整数, 于是 $f(x) = 1$. 因此

$$(8) \quad \lim_{m \rightarrow \infty} \lim_{n \rightarrow \infty} (\cos m! \pi x)^{2n} = \begin{cases} 0 & (x \text{ 是无理数}), \\ 1 & (x \text{ 是有理数}). \end{cases}$$

因此就得到了一个处处间断的极限函数, 它不是 Riemann 可积的 (第六章, 习题 4).

7.5 例 设 x 是实数, $n=1, 2, 3, \dots$,

$$(9) \quad f_n(x) = \frac{\sin nx}{\sqrt{n}},$$

于是

$$f(x) = \lim_{n \rightarrow \infty} f_n(x) = 0.$$

那么 $f'(x)=0$, 另外

$$f'_n(x) = \sqrt{n} \cos nx$$

所以, $\{f'_n\}$ 不收敛于 f' . 例如, 当 $n \rightarrow \infty$ 时,

$$f'_n(0) = \sqrt{n} \rightarrow +\infty.$$

而 $f'(0)=0$.

7.6 例 设 $0 \leq x \leq 1, n=1, 2, 3, \dots$. 令

$$(10) \quad f_n(x) = n^2 x(1-x^2)^n$$

对于 $0 < x \leq 1$, 根据定理 3.20(d)

$$\lim_{n \rightarrow \infty} f_n(x) = 0.$$

又因为 $f_n(0)=0$, 所以

$$(11) \quad \lim_{n \rightarrow \infty} f_n(x) = 0 \quad (0 \leq x \leq 1)$$

略加计算就能证明

$$\int_0^1 x(1-x^2)^n dx = \frac{1}{2n+2},$$

因此, 虽然有(11)式, 但是当 $n \rightarrow \infty$ 时,

$$\int_0^1 f_n(x) dx = \frac{n^2}{2n+2} \rightarrow +\infty$$

如果在(10)式中用 n 代替 n^2 , (11)式仍然成立. 但是现在得到的是

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^1 f_n(x) dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{n}{2n+2} = \frac{1}{2}$$

而

$$\int_0^1 [\lim_{n \rightarrow \infty} f_n(x)] dx = 0$$

所以, 积分的极限和极限的积分, 即使两者都是有限的, 也未必相等.

这些例题说明, 如果粗心地对调了两个极限过程会错误到什么样子. 鉴于这一点, 我们定义一个新的收敛方式, 它比定义 7.1 中规定的逐点收敛性要强些. 这种新的收敛方式能使我们达到正

面的结果.

一致收敛性

7.7 定义 如果对每一个 $\varepsilon > 0$, 有一个整数 N , 使得 $n \geq N$ 时, 对于一切 $x \in E$, 成立

$$(12) \quad |f_n(x) - f(x)| \leq \varepsilon,$$

我们就说, 函数序列 $\{f_n\}$, $n = 1, 2, 3, \dots$, 在 E 上一致收敛于函数 f .

显然, 每个一致收敛序列一定逐点收敛. 很明显, 这两个概念之间的差异在于: 如果 $\{f_n\}$ 在 E 上逐点收敛, 那便存在着这样的函数 f , 它对于每个 $\varepsilon > 0$, 又对于每个 $x \in E$, 有一个整数 N . 如果 $n \geq N$, (12) 式就成立, 这里的 N 既依赖于 ε , 又依赖于 x . 如果 $\{f_n\}$ 在 E 上一致收敛, 便对于每个 $\varepsilon > 0$, 能够对于一切 $x \in E$, 找出一个整数 N , 当 $n \geq N$ 时, (12) 式成立.

级数 $\sum f_n(x)$ 的部分和, 规定为

$$\sum_{i=1}^n f_i(x) = s_n(x)$$

如果部分和序列 $\{s_n\}$ 在 E 上一致收敛, 我们就说级数 $\sum f_n(x)$ 在 E 上一致收敛.

下面是关于一致收敛性的 Cauchy 准则:

7.8 定理 定义在 E 上的函数序列 $\{f_n\}$ 在 E 上一致收敛, 当且仅当: 对于每个 $\varepsilon > 0$, 存在着一个整数 N , 使得 $m \geq N$, $n \geq N$ 和 $x \in E$ 时, 成立

$$(13) \quad |f_n(x) - f_m(x)| \leq \varepsilon.$$

证 假设 $\{f_n\}$ 在 E 上一致收敛, 并且令 f 是极限函数. 那么, 有一个整数 N , 使得 $n \geq N$ 和 $x \in E$ 时成立

$$|f_n(x) - f(x)| \leq \frac{\varepsilon}{2}.$$

于是 $n \geq N, m \geq N, x \in E$ 时

$$|f_n(x) - f_m(x)| \leq |f_n(x) - f(x)| + |f(x) - f_m(x)| \leq \varepsilon.$$

反之, 假设 Cauchy 条件成立. 根据定理 3.11, 序列 $\{f_n\}$ 对于每个 x 收敛于一个极限, 我们可称它为 $f(x)$. 于是, 序列 $\{f_n\}$ 在 E 上收敛于 f . 我们必须证明这个收敛是一致的.

假设给定了 $\varepsilon > 0$, 再选定使 (13) 式成立的 N . 在 (13) 里把 n 固定了, 而让 $m \rightarrow \infty$. 由于当 $m \rightarrow \infty$ 时, $f_m(x) \rightarrow f(x)$, 这就得到了对于个个 $n \geq N$ 和个个 $x \in E$ 都能适用的

$$(14) \quad |f_n(x) - f(x)| \leq \varepsilon.$$

这就完成了证明.

下面的判别准则往往有用:

7.9 定理 假设

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

令

$$M_n = \sup_{x \in E} |f_n(x) - f(x)|.$$

那么, 在 E 上 $f_n \rightarrow f$ 是一致的, 当且仅当: $n \rightarrow \infty$ 时, $M_n \rightarrow 0$.

这是定义 7.7 的直接结果. 证明从略.

对于级数, 有一个判别一致收敛性十分方便的方法, 它归功于

Weierstrass.

7.10 定理 假设 $\{f_n\}$ 是定义在 E 上的函数序列, 并且, 假设

$$|f_n(x)| \leq M_n \quad (x \in E, n = 1, 2, 3, \dots).$$

如果 $\sum M_n$ 收敛, 那么, $\sum f_n$ 便在 E 上一致收敛.

注意, 并没有说它的逆命题怎样 (而实际上是不真的).

证 如果 $\sum M_n$ 收敛, 那么, 对于任意的 $\varepsilon > 0$, 只要 m 和 n 都充分地大, 便能够

$$\left| \sum_{i=n}^m f_i(x) \right| \leq \sum_{i=n}^m M_i \leq \varepsilon \quad (x \in E).$$

根据定理 7.8, 就得出一致收敛性.

一致收敛性与连续性

7.11 定理 假设在度量空间内的集 E 上 f_n 一致收敛于 f . 设 x 是 E 的极限点. 再假设

$$(15) \quad \lim_{t \rightarrow x} f_n(t) = A_n \quad (n = 1, 2, 3, \dots).$$

那么 $\{A_n\}$ 收敛, 并且

$$(16) \quad \lim_{t \rightarrow x} f(t) = \lim_{n \rightarrow \infty} A_n.$$

换句话说, 这结论就是

$$(17) \quad \lim_{t \rightarrow x} \lim_{n \rightarrow \infty} f_n(t) = \lim_{n \rightarrow \infty} \lim_{t \rightarrow x} f_n(t).$$

证 假设给定了 $\varepsilon > 0$. 按 $\{f_n\}$ 的一致收敛性, 存在着 N , 使得 $n \geq N$, $m \geq N$ 和 $t \in E$ 时成立

$$(18) \quad |f_n(t) - f_m(t)| \leq \varepsilon$$

在(18)式中, 让 $t \rightarrow x$. 得到的是, 当 $n \geq N$, $m \geq N$ 时

$$|A_n - A_m| \leq \varepsilon.$$

于是 $\{A_n\}$ 是 Cauchy 序列, 因而收敛. 比如说收敛于 A .

其次

$$(19) \quad |f(t) - A| \leq |f(t) - f_n(t)| + |f_n(t) - A_n| + |A_n - A|.$$

先选取 n , 要求对于一切 $t \in E$ 使得

$$(20) \quad |f(t) - f_n(t)| \leq \frac{\varepsilon}{3}$$

(根据一致收敛性, 这是能做到的), 并且使得

$$(21) \quad |A_n - A| \leq \frac{\varepsilon}{3}.$$

然后对于这个 n , 选取 x 的一个邻域 V , 使得 $t \in V \cap E$, $t \neq x$ 能保证

$$(22) \quad |f_n(t) - A_n| \leq \frac{\varepsilon}{3}.$$

将(20)到(22)的三个不等式代入(19)式, 结果就是: 只需 $t \in V \cap E, t \neq x$ 便有

$$|f(t) - A| \leq \varepsilon.$$

这和(16)式等价.

7.12 定理 如果 $\{f_n\}$ 是 E 上的连续函数的序列, 并且在 E 上, f_n 一致收敛于 f . 那么, f 在 E 上连续.

这个非常重要的结果是定理 7.11 的直接推论.

它的逆命题不真. 也就是说, 虽然收敛不是一致的, 但是, 一个连续函数的序列也可以收敛于一个连续函数. 例题 7.6 就属于这一类(为看清这一点, 需要应用定理 7.9). 但是, 有一种情形, 我们可以断定逆命题是正确的:

7.13 定理 假定 K 是紧集, 并且

(a) $\{f_n\}$ 是 K 上的连续函数序列,

(b) $\{f_n\}$ 在 K 上逐点收敛于连续函数 f ,

(c) 对于一切 $x \in K$ 和 $n = 1, 2, 3, \dots, f_n(x) \geq f_{n+1}(x)$.

那么在 K 上 $f_n \rightarrow f$ 是一致的.

证 令 $g_n = f_n - f$, 于是 g_n 是连续的, 在每点上 $g_n \rightarrow 0$ 并且 $g_n \geq g_{n+1}$. 现在要证明 g_n 在 K 上一致收敛于 0.

假设给定了 $\varepsilon > 0$, 假设 K_n 是使 $g_n(x) \geq \varepsilon$ 的一切 $x \in E$ 的集. 由于 g_n 连续, 那么 K_n 是闭的(定理 4.8), 所以是紧的(定理 2.35). 由于 $g_n \geq g_{n+1}$, 我们得到 $K_n \supset K_{n+1}$. 固定了 $x \in K$. 由于 $g_n(x) \rightarrow 0$, 我们知道只需 n 充分大, 便能使 $x \notin K_n$, 所以 $x \notin \bigcap K_n$. 换句话说, $\bigcap K_n$ 是空的, 从而对应于某个 N 的 K_N 是空的(定理 2.36). 必然对于一切 $x \in K$ 和一切 $n \geq N$, 有 $0 \leq g_n(x) < \varepsilon$. 这就证明了这定理.

注意紧性是必不可少的。例如:

$$f_n(x) = \frac{1}{nx+1}, \quad (0 < x < 1, \quad n=1, 2, 3, \dots)$$

在 $(0, 1)$ 里 $f_n(x)$ 单调地趋于零, 然而不是一致收敛。

7.14 定义 如果 X 是度量空间, $\mathcal{C}(X)$ 就表示以 X 为定义域的复值连续有界函数的集。

[注意, 如果 X 是紧集, 有界性就是多余的(定理 4.15)。所以如果 X 是紧集, $\mathcal{C}(X)$ 就由 X 上的一切复值连续函数组成。]

我们给每个 $f \in \mathcal{C}(X)$ 配置上它的上确范数

$$\|f\| = \sup_{x \in X} |f(x)|.$$

因为假定了 f 是有界的, 那么 $\|f\| < \infty$ 。显然只有当 $f(x) = 0$ (对于每个 $x \in X$) 时, 才有 $\|f\| = 0$ 。如果 $h = f + g$, 那么对于一切 $x \in X$,

$$|h(x)| \leq |f(x)| + |g(x)| \leq \|f\| + \|g\|.$$

所以

$$\|f+g\| \leq \|f\| + \|g\|.$$

如果定义 $f \in \mathcal{C}(X)$ 与 $g \in \mathcal{C}(X)$ 之间的距离是 $\|f-g\|$, 那么它就满足关于度量的公理 2.15。

于是我们使 $\mathcal{C}(X)$ 变成了度量空间。

定理 7.9 可以重述为

对于 $\mathcal{C}(X)$ 的度量来说, 序列 $\{f_n\}$ 收敛于 f , 当且仅当 f_n 在 X 上一致收敛于 f 。

因此 $\mathcal{C}(X)$ 的闭子集有时叫做一致闭的, 集 $\mathcal{A} \subset \mathcal{C}(X)$ 的闭包叫做它的一致闭包, 等等。

7.15 定理 上边说的度量使得 $\mathcal{C}(X)$ 变成了完备度量空间。

证 设 $\{f_n\}$ 是 $\mathcal{C}(X)$ 里的 Cauchy 序列。这就是说, 对应于每个 $\varepsilon > 0$ 有一个 N 使得 $\|f_n - f_m\| < \varepsilon$ 在 $n \geq N$ 及 $m \geq N$ 时成立。

于是根据定理 7.8 有一个函数 f , 它以 X 为定义域, 而 $\{f_n\}$ 一致收敛于它. 根据定理 7.12, f 是连续的. 不仅如此, 由于总有一个 n , 使得 $|f(x) - f_n(x)| < 1$ 对于一切 $x \in X$ 成立, 而 f_n 又有界, 那么 f 是有界的.

所以 $f \in \mathcal{C}(X)$, 而且由于 f_n 在 X 上一致收敛于 f , 那么当 $n \rightarrow \infty$ 时 $\|f - f_n\| \rightarrow 0$.

一致收敛性与积分

7.16 定理 设 α 在 $[a, b]$ 上单调递增. 假定在 $[a, b]$ 上 $f_n \in \mathcal{R}(\alpha)$, $n=1, 2, 3, \dots$, 再假定在 $[a, b]$ 上 $f_n \rightarrow f$ 是一致的, 那么在 $[a, b]$ 上 $f \in \mathcal{R}(\alpha)$, 而且

$$(23) \quad \int_a^b f d\alpha = \lim_{n \rightarrow \infty} \int_a^b f_n d\alpha.$$

(极限的存在性是本结论的一部分.)

证 只对于实函数证明这定理就够了. 令

$$(24) \quad \varepsilon_n = \sup |f_n(x) - f(x)|,$$

这上确界是在 $a \leq x \leq b$ 上取的. 这时

$$f_n - \varepsilon_n \leq f \leq f_n + \varepsilon_n,$$

所以 f 的上下积分(参阅定义 6.2)满足

$$(25) \quad \int_a^b (f_n - \varepsilon_n) d\alpha \leq \int_a^b f d\alpha \leq \int_a^b (f_n + \varepsilon_n) d\alpha.$$

从而

$$0 \leq \int_a^b f d\alpha - \int_a^b f_n d\alpha \leq 2\varepsilon_n [\alpha(b) - \alpha(a)].$$

由于 $n \rightarrow \infty$ 时, $\varepsilon_n \rightarrow 0$ (定理 7.9), 可见 f 的上下积分相等.

所以 $f \in \mathcal{R}(\alpha)$. 现在再一次运用(25), 就得到

$$(26) \quad \left| \int_a^b f d\alpha - \int_a^b f_n d\alpha \right| \leq \varepsilon_n [\alpha(b) - \alpha(a)]$$

因此(23)成立.

推论 假若在 $[a, b]$ 上 $f_n \in \mathcal{R}(\alpha)$, 而且

$$f(x) = \sum_{n=1}^{\infty} f_n(x) \quad (a \leq x \leq b)$$

这级数在 $[a, b]$ 上一致收敛, 则

$$\int_a^b f d\alpha = \sum_{n=1}^{\infty} \int_a^b f_n d\alpha.$$

换句话说; 这级数可以逐项积分.

一致收敛性与微分

从例题 7.5 已经知道, 由 $\{f_n\}$ 的一致收敛不能推出序列 $\{f'_n\}$ 的什么性质. 当 $f_n \rightarrow f$ 时, 为了断定 $f'_n \rightarrow f'$ 需要有较强的假设.

7.17 定理 假设 $\{f_n\}$ 是 $[a, b]$ 上的可微函数序列, 并且 $[a, b]$ 上有某点 x_0 使 $\{f_n(x_0)\}$ 收敛. 如果 $\{f'_n\}$ 在 $[a, b]$ 上一致收敛, 那么 $\{f_n\}$ 便在 $[a, b]$ 上一致收敛于某函数 f ; 并且

$$(27) \quad f'(x) = \lim_{n \rightarrow \infty} f'_n(x) \quad (a \leq x \leq b).$$

证 假设给定了 $\varepsilon > 0$, 选取一个 N 要它使得当 $n \geq N$ 与 $m \geq N$ 时有

$$(28) \quad |f_n(x_0) - f_m(x_0)| < \frac{\varepsilon}{2}$$

及

$$(29) \quad |f'_n(t) - f'_m(t)| < \frac{\varepsilon}{2(b-a)} \quad (a \leq t \leq b).$$

假如把中值定理 5.19 用于函数 $f_n - f_m$, 那么由(29)式可以说, 当 $n \geq N, m \geq N$ 时, 对于 $[a, b]$ 上任意的 x 与 t , 有

$$(30) \quad |f_n(x) - f_m(x) - f_n(t) + f_m(t)| \leq \frac{|x-t|\varepsilon}{2(b-a)} \leq \frac{\varepsilon}{2}$$