可积函数的逼近与 Riemann 引理*

梅加强

南京大学数学系

http://math.nju.edu.cn/~meijq

定理 1. 设 f 为 $[a,b]$ 上 Riemann 可积函数, 则 $\forall \epsilon > 0$,

(1) 存在 $[a,b]$ 上的阶梯函数 g, 使得

$$\int_a^b |f-g| \, \mathrm{d}x < \epsilon,$$

(2) 存在 $[a,b]$ 上的连续函数 h, 使得

$$\int_a^b |f-h| \, \mathrm{d}x < \epsilon.$$

证明: (1). 由 f 可积知,$\forall \epsilon > 0$, $\exists$ $[a,b]$ 的一个分割 $\pi: a = x_0 < x_1 < \cdots < x_n = b$, s.t

$$\sum_{i=1}^{n} \omega_i(f) \cdot \triangle x_i < \epsilon.$$

在 $[x_{i-1}, x_i]$ 中取定 ξ_i(例如取 $\xi_i = x_i$), 则 $\forall x \in [x_{i-1}, x_i]$, 有

$$|f(x) - f(\xi_i)| \le \omega_i(f),$$

* 《数学分析》补充材料, 2006.2

令 g 为在 $[x_{i-1},x_i]$ 中值为 $f(\xi_i)$ 的阶梯函数, 则

$$\begin{aligned}
\int_a^b |f-g|\,\mathrm{d}x &= \sum_{i=1}^n \int_{x_{i-1}}^{x_i} |f(x)-g(x)|\,\mathrm{d}x \\
&= \sum_{i=1}^n \int_{x_{i-1}}^{x_i} |f(x)-g(\xi_i)|\,\mathrm{d}x \\
&\le \sum_{i=1}^n \int_{x_{i-1}}^{x_i} \omega_i(f)\,\mathrm{d}x \\
&= \sum_{i=1}^n \omega_i(f)\cdot\triangle x_i < \epsilon.
\end{aligned}$$

(2). 由 (1), 可设 f 为阶梯函数. 不失一般性, 又可以假设 f 只取两个值:

$$f(x)=\begin{cases} y_1, & x\in[a,c] \\ y_2, & x\in[c,b] \end{cases}$$

考虑连续函数

$$h(x)=\begin{cases} y_1, & x\in[a,c-\delta] \\ \text{线性}, & x\in[c-\delta,c+\delta] \\ y_2, & x\in[c+\delta,b] \end{cases}$$

记 $M=\max\{|y_1|,|y_2|\}$. 易知有下面的估计

$$\int_a^b |f-h|\,\mathrm{d}x < 4M\delta,$$

因此 δ 充分小时 h 为所求连续函数.

注: 上述 g,h 与 f 满足同样的上下确界.

定理 2. (Riemann-Lebesgue 引理) 设 f 在 $[a,b]$ 上可积, 则

$$\lim_{\lambda\to+\infty}\int_a^b f(x)\cdot\sin\lambda x\,\mathrm{d}x=0.$$

证明: (i). 如果 f 为常数 c, 则

$$\lim_{\lambda\to+\infty}\int_a^b f(x)\cdot\sin\lambda x\,\mathrm{d}x=\lim_{\lambda\to+\infty}\frac{c}{\lambda}(\cos\lambda a-\cos\lambda b)=0.$$

(ii). 一般地, $\forall\,\epsilon>0$, 由定理 1, $\exists$ 阶梯函数 g, $s.t$

$$\int_a^b |f-g|\,\mathrm{d}x<\epsilon/2,$$

由 (i) 易见, $\lim\limits_{\lambda\to+\infty}\int_a^b g(x)\cdot\sin\lambda x\,\mathrm{d}x=0$. 故 λ 充分大时,

$$\Big|\int_a^b g(x)\cdot\sin\lambda x\,\mathrm{d}x\Big|<\epsilon/2.$$

此时, 有

$$\begin{aligned}\Big|\int_a^b f(x)\cdot\sin\lambda x\,\mathrm{d}x\Big| &\le \Big|\int_a^b (f(x)-g(x))\cdot\sin\lambda x\,\mathrm{d}x\Big|+\Big|\int_a^b g(x)\cdot\sin\lambda x\,\mathrm{d}x\Big|\\ &\le \int_a^b |f-g|\,\mathrm{d}x+\epsilon/2\\ &< \epsilon/2+\epsilon/2=\epsilon.\end{aligned}$$

即 $\lim\limits_{\lambda\to+\infty}\int_a^b f(x)\cdot\sin\lambda x\,\mathrm{d}x=0$.