

积分

不定积分：导函数的逆运算

若 $F'(x) = f(x)$, 则 $\int f(x)dx = F(x) + C$

注意其中的"+C"。这是由于常数的导函数是0。所以一个函数的不定积分是“一族”互相相差定值的函数。

常见不定积分的公式见附录!

常见积分方法

第一换元法 (凑微分法)

$$\int f(\varphi(x))\varphi'(x)dx = \int f(\varphi(x))d\varphi(x) = F(\varphi(x)) + C$$

人话：找到函数中比较好积的部分，放到d里面，把这个作为积分变量积分。**这很考验观察！不然为什么叫凑呢**

Example 1

$$\int \tan x \sec x dx = \int \frac{\sin x}{\cos^2 x} dx = \int \frac{1}{\cos^2 x} d(-\cos x) = -(-\frac{1}{\cos x}) + C = \frac{1}{\cos x} + C$$

Example 2

$$\int \frac{1}{e^x+1} dx = \int \frac{e^x}{e^{2x}+e^x} dx = \int \frac{1}{e^x(e^x+1)} de^x = \int (\frac{1}{e^x} - \frac{1}{e^x+1}) de^x = \ln e^x - \ln(e^x+1) + C = x - \ln(e^x+1) + C$$

分部积分法

和第一积分法经常打出连招！瞬间秒杀积分大部分于无形。在涉及三角函数、指数函数的积分中经常使用！

$$\int f(x)g'(x)dx = \int f(x)dg(x) = f(x)g(x) - \int g(x)df(x)$$

Example

求 $\int x \sin x dx, \int x^2 e^x dx, \int \arctan x dx$

第二换元法

$$\text{令 } x = \varphi(t), \int f(\varphi(t))\varphi'(t)dx = \int f(\varphi(t))d\varphi(t) = F(\varphi(t)) + C \therefore \int f(x)dx = F(\varphi^{-1}(t)) + C$$

人话：把x用t的函数代换，使积分形式易于用t表示，最后在结果中代换回来。

⚠ 注意出现反函数!

第二换元法有一个大多数情况都满足的**重要条件**, $\varphi(t)$ **单调可导且导函数不为0!**

Example

求 $\int \frac{1}{x^2+a^2} dx, \int \sqrt{a^2-x^2} dx, \int \sqrt{x^2-a^2} dx, \int \sqrt{x^2+a^2} dx$

基本方法就这么多，具体积分方法参见网课部分。以下例题可检验学习成果：

例题

Example

1. 有理分式的积分 $\int \frac{2x^2+4x+1}{x(x+1)^2} dx, \int \frac{1}{x^4+1} dx$
2. 万能公式 $\int \frac{1}{2\cos\theta+3} d\theta, \int \frac{1}{1+\cos\theta+\sin\theta} d\theta$
3. 无理根式 $\int \sqrt{\frac{x+1}{x-1}} dx, \int \frac{1}{\sqrt{x^2-x+1}} dx$

定积分：分割作和取极限

rt, 对函数在 $[a,b]$ 上作分割 $\Delta(\Delta = \{[x_i, x_{i+1}] | 0 \leq i \leq n-1\} a = x_0 < x_1 < x_2 < \dots < x_{n-1} < x_n = b)$, 则若 $\lim_{\|\Delta\| \rightarrow 0} \sum_{i=0}^{n-1} f(\xi_i)(x_{i+1} - x_i)$ 存在则定积分 I 存在, 记 $I = \int_a^b f(x) dx = \lim_{\|\Delta\| \rightarrow 0} \sum_{i=0}^{n-1} f(\xi_i)(x_{i+1} - x_i)$ 。

可积理论一直不是考试重点，近期考试只在一道证明涉及到了关于函数可积的结论。故仅在此提点。详细理论见附录II。

关于可积理论的一些结论

对于定义在 $[a,b]$ 的函数

1. 函数连续必可积
2. 函数单调必可积
3. 函数仅有有限个间断点必可积

牛顿-莱布尼茨公式

若 $f \in C[a, b], \int f(x) dx = F(x) + C (F'(x) = f(x))$, 则 $\int_a^b f(x) dx = F(b) - F(a) = F(x)|_a^b$

证明：欲证其相等，即证 $\forall \epsilon > 0, |\int_a^b f(x) dx - (F(b) - F(a))| < \epsilon$

设对 $[a, b]$ 作 n 段分割, $F(b) - F(a) = \sum_{i=1}^n (F(x_i) - F(x_{i-1})) = \sum_{i=1}^n f(\xi_i) \Delta x_i$

$\therefore \int_a^b f(x) dx < \sum_{i=1}^n M(\xi_i) \Delta x_i$ 且极限相等

$\therefore \forall \epsilon_1 = \frac{\epsilon}{2}, \exists \delta_1, s.t. \forall \|\Delta\| < \delta_1, |\int_a^b f(x) dx - \sum_{i=1}^n M(\xi_i) \Delta x_i| < \frac{\epsilon}{2}$

$\therefore \forall \epsilon_2 = \frac{\epsilon}{2(b-a)}, \exists \delta_2, \forall |x' - x''| < \delta_2, |f(x') - f(x'')| < \frac{\epsilon}{2(b-a)}$ (Cantor定理)

$\therefore \forall \|\Delta\| < \min\{\delta_1, \delta_2\}, |\int_a^b f(x) dx - \sum_{i=1}^n M(\xi_i) \Delta x_i| < \frac{\epsilon}{2}$,

$|\sum_{i=1}^n f(\xi_i) \Delta x_i - \sum_{i=1}^n M(\xi_i) \Delta x_i| = |\sum_{i=1}^n (f(\xi_i) - M(\xi_i)) \Delta x_i| \leq \sum_{i=1}^n |f(\xi_i) - M(\xi_i)| \Delta x_i < \frac{\epsilon}{2(b-a)}(b-a) = \frac{\epsilon}{2}$

$\therefore |\int_a^b f(x) dx - (F(b) - F(a))| \leq |\int_a^b f(x) dx - \sum_{i=1}^n M(\xi_i) \Delta x_i| + |\sum_{i=1}^n f(\xi_i) \Delta x_i - \sum_{i=1}^n M(\xi_i) \Delta x_i| < \epsilon$

Q.E.D.

Warning

1. 有原函数的函数必可积，但可积函数不一定有原函数！（可以用带第一类间断点的函数轻松举例）
2. 可积函数即使有原函数可能也求不出原函数是什么。因此不是所有积分都能用牛顿-莱布尼茨公式计算

我们做到的绝大多数定积分都能通过牛顿-莱布尼茨公式转化为不定积分求解。因此，在定积分中，第一、第二换元法，分部积分法依然适用！

Example

尝试在定积分的练习中找几个计算0到1的定积分!

基本性质

1. 线性性, 保序性, 保号性, 迫敛性准则
2. 区间可加性 $\int_a^b = \int_a^c + \int_c^b$

定积分可以进行很多计算 (计算各种面积, 体积), 还有一些经典换元 (对称换元, 三角函数利用诱导公式换元, 极坐标变换)。具体内容参见网课部分。以下题目为历年计算题, 供大家练习参考!

Example

1. $f(x) = \int_0^x \sqrt{\cos t} dt$, 求 $y = f(x)$ 在 $[0, 1]$ 的弧长
2. 求 $e^x, ex, x = 0$ 三根曲线所夹区域绕 x 轴一周的体积
3. 求 $f(x) = \int_{-\sqrt{3}}^x \sqrt{3 - t^2} dt$ 在 $[-\sqrt{3}, \sqrt{3}]$ 的弧长
4. 求 $r = \sqrt{\cos 2\theta}$ 围成图形的面积

变限积分与中值定理

第一中值定理

$f \in C[a, b], \exists h \in [a, b], s.t. \int_a^b f(x) dx = f(h)(b - a) = f(a + \theta(b - a))(b - a)$, 此时称 $f(h)$ 为 $f(x)$ 在 $[a, b]$ 的积分平均。

人话: 我能在无限个高度中找一个平均高度!

变限积分

Note

连续函数必有原函数, 尽管我们不一定知道它是什么。

$f \in C[a, +\infty], F(x) = \int_a^x f(t) dt$, 则 $F'(x) = f(x)$

也就是说, 不管原函数能不能初等表示, 我们找到了一个函数, 使它的导数等于 $f(x)$!

证明: $\forall x_0 \in [a, +\infty]$

$$\lim_{x \rightarrow x_0} \frac{F(x) - F(x_0)}{x - x_0} = \lim_{x \rightarrow x_0} \frac{\int_{x_0}^x f(x) dx}{x - x_0} = \lim_{x \rightarrow x_0} f(x_0 + \theta(x - x_0)) = f(x_0)$$

由此, 当我们要证明一个关于 x 的积分不等式, 结果发现做不出来时, 我们可以把看起来像参数的一些量当作未知数, 把 x 当作参数!

通常, 被看作未知数的就是积分上限。

Example 1

证明 Cauchy - Schwarz 不等式: $(\int_a^b f(x)g(x) dx)^2 \leq \int_a^b f^2(x) dx \int_a^b g^2(x) dx$

Example 2

当上限、下限是关于 x 的函数时, $F(x) = \int_{\varphi(x)}^{\psi(x)} f(t)dt, F'(x) = \psi'(x)f(\psi(x)) - \varphi'(x)f(\varphi(x))$

拓展: 当被积函数里面出现 x 了, 那还怎么求导呢?

$$F(x) = \int_a^x f(x, t)dt, F'(x) = \lim_{x \rightarrow x_0} \frac{F(x) - F(x_0)}{x - x_0} = \lim_{x \rightarrow x_0} \frac{\int_a^{x_0} (f(x, t) - f(x_0, t))dt + \int_{x_0}^x f(x, t)dt}{x - x_0} = \int_a^{x_0} f_X(x_0, t)dt + f(x_0, x_0)$$

书上有道作业题, $F(x) = \int_0^x (x-t)f'(t)dt$, 求 $F'(x)$, 并令 $f'(t) = \sin t$ 求解, 说的就是这个事情。

这部分在淑芬II (H) 中会有介绍 (含参积分), 但篇幅不多, 且大概率不考。

第二中值定理

1. Bonnet型:

$$(i) x \in [a, b], g(x) \geq 0, g(x) \downarrow, \exists \xi, s.t. \int_a^b f(x)g(x)dx = g(a) \int_a^\xi f(x)dx$$

$$(ii) x \in [a, b], g(x) \geq 0, g(x) \uparrow, \exists \eta, s.t. \int_a^b f(x)g(x)dx = g(b) \int_\eta^b f(x)dx$$

下证(i): 若 $g(a) = 0$, 则 $g(x) \equiv 0$ (表示在区间上恒为0), 左 = 右 = 0

若 $g(a) \neq 0$, 则设 $F(\xi) = \int_a^\xi f(x)dx$ 最大值 M , 最小值 m ,

\therefore 根据连续函数介值性即证 $mg(a) < \int_a^b f(x)g(x)dx < Mg(a)$

对 g 作分割 Δ , 则 $\int_a^b f(x)g(x)dx = \sum_{i=1}^n \int_{x_{i-1}}^{x_i} f(x)(g(x) - g(x_{i-1}))dx + \sum_{i=1}^n g(x_{i-1}) \int_{x_{i-1}}^{x_i} f(x)dx = I_1 + I_2$

对 I_1 应用可积理论, $\therefore f(x)$ 可积必有界, 故 $|f(x)| < L$

$$\forall \frac{\epsilon}{L} > 0, \sum_{i=1}^n |g(x) - g(x_{i-1})|\Delta x < \sum_{i=1}^n \omega_i \Delta x < \frac{\epsilon}{L}$$

$$\therefore |I_1| < \sum_{i=1}^n |f(x)|\omega_i \Delta x < L \cdot \frac{\epsilon}{L} = \epsilon$$

$$\text{对 } I_2, \sum_{i=1}^n g(x_{i-1}) \int_{x_{i-1}}^{x_i} f(x)dx = \sum_{i=1}^n g(x_{i-1})(F(x_i) - F(x_{i-1})) = g(x_{n-1})F(x_n) - g(x_0)F(x_0) + \sum_{i=1}^{n-1} F(x_i)(g(x_{i-1}) - g(x_i))$$

$\therefore F(x_0) = F(a) = 0$, 而 $F(x) < M$, 故 $I_2 < Mg(x_0) = Mg(a)$, 同理 $M > g(a)$, 故 $-\epsilon + mg(a) < I_1 + I_2 < \epsilon + Mg(a)$, 由 ϵ 任意性得证

2. Wierstrass型:

$$g \text{ 单调, } f \text{ 可积, } \int_a^b f(x)g(x)dx = g(a) \int_a^\xi f(x)dx + g(b) \int_\xi^b f(x)dx$$

证明: 不妨 g 递减, 令 $G(x) = g(x) - g(b)$, $G(x)$ 非负递减,

$$\exists \xi, \int_a^b f(x)G(x)dx = G(a) \int_a^\xi f(x)dx$$

$$\therefore \int_a^b f(x)(g(x) - g(b))dx = (g(a) - g(b)) \int_a^\xi f(x)dx$$

移项则定理成立。递增时同理也满足。

目前在考试中第二积分中值定理的应用好像并不多。(去年压轴比较像, 但是使用变限积分即可证明)

大家补天补不到这里的话就选择性跳过吧~

Example

还记得在变限积分证过的吗? 那就使用Wierstrass型第二积分中值定理证明Bonnet型中值定理吧! (Hint 换元法)

反常积分: 唯一缺点是泰过丸美~的逆否命题

当然是不完美不是缺点子! 这不严谨。

反常积分分为两类，一类是无穷积分，另一类是瑕积分。其中，无穷积分为考试重点，且下学期很多知识与这个有关！

无穷积分

敛散性判别

首要条件！ $\lim_{x \rightarrow +\infty} f(x) = 0$ ，否则必发散！

定义法

$\lim_{b \rightarrow +\infty} \int_a^b f(x) dx = I$ ，则称该积分收敛，且 $\int_a^{+\infty} f(x) dx = I$ ，极限不存在或为无穷时积分发散。

回想一下数列、函数的极限。当我们不知道函数、数列的极限是什么的时候，我们使用什么判别敛散性？

柯西收敛定理

$\forall \epsilon > 0, \exists N, \forall x_1, x_2 > N, |\int_{x_1}^{x_2} f(x) dx| < \epsilon$ ，则 $\int_a^{+\infty} f(x) dx$ 收敛

个人感觉有点问题。应该加入条件 $\int_a^N f(x) dx$ 是正常积分或收敛。不加这个条件能举出什么反例？

绝对值判别法

$\int_a^{+\infty} |f(x)| dx$ 收敛则 $\int_a^{+\infty} f(x) dx$ 收敛

由此新增了绝对收敛和条件收敛的概念！

如果我们把函数的“正半”和“负半”积分，那么对于绝对收敛和条件收敛的函数，会有哪些现象？

比较判别法

$f(x) > 0, \forall b > a, \int_a^b f(x) dx < J$ ，则 $\int_a^{+\infty} f(x) dx$ 收敛

$0 < f(x) < g(x), \int_a^{+\infty} g(x) dx$ 收敛则 $f(x)$ 收敛。反之 $f(x)$ 发散则 $g(x)$ 发散

判断以下积分敛散性

- $\int_1^{+\infty} \frac{1}{x^p} dx$
- $\int_1^{+\infty} \sin(\frac{1}{x}) dx$ (积分下界变成0呢?)
- $\int_1^{+\infty} \frac{\sin x}{x^2} dx$

以下为重点！

狄利克雷-阿贝尔判别法

阿贝尔变换

$$S = \sum_{i=1}^n a_i b_i = \sum_{i=1}^n [(b_i - b_{i-1}) \sum_{j=1}^{n-i+1} a_j] \text{ (这里定义 } b_0 = 0 \text{)}$$

看起来晕晕的！其实画个图就明白了：可以看作好几个矩形水平叠在一起，然后横向求面积！

真要证的话，从右到左展开即可！

Note

这个变换可以直接用于证明级数数列和收敛

回头再看看 Bonnet 型第二中值定理的证明，为什么被这样奇怪地拆分了？

阿贝尔判别法

$\int_a^{+\infty} f(x) dx$ 收敛， $g(x)$ 单调有界，则 $\int_a^{+\infty} f(x)g(x) dx$ 收敛

证明：即证 $\forall \epsilon > 0, \exists N, \forall n_1, n_2 > N, |\int_{n_1}^{n_2} f(x)g(x) dx| < \epsilon$

熟悉吗？直接应用第二积分中值定理即可。完整证明阿贝尔判别法就要用到阿贝尔变换。这一点在下学期讲的级数中更加常见，阿贝尔变换也更加重要。

狄利克雷判别法

$\int_a^{+\infty} f(x)dx$ 有界, $g(x)$ 单调收敛于 0, 则 $\int_a^{+\infty} f(x)g(x)dx$ 收敛

证明: $\lim_{x \rightarrow +\infty} g(x) = 0 \Rightarrow \forall \epsilon, \exists N, s.t. \forall x > N, |g(x)| < \frac{\epsilon}{4L}$, 其中 L 为 $\int_a^{+\infty} f(x)dx$ 的界, $|\int_a^{+\infty} f(x)dx| < L$

$$\therefore \int_{x_1}^{x_2} f(x)dx = (\int_{x_1}^{+\infty} - \int_{x_2}^{+\infty}) f(x)dx < |\int_{x_1}^{+\infty} f(x)dx| + |\int_{x_2}^{+\infty} f(x)dx| < 2L$$

$$\forall b > a, \int_a^b f(x)g(x)dx = g(a) \int_a^\xi f(x)dx + g(b) \int_\xi^b f(x)dx$$

$$\therefore |\int_a^b f(x)g(x)dx| < |g(a)| |\int_a^\xi f(x)dx| + |g(b)| |\int_\xi^b f(x)dx| < \frac{\epsilon}{4L} \times 2L + \frac{\epsilon}{4L} \times 2L = \epsilon$$

Q.E.D.

定理的证明不难, 而且实际使用的时候可以混用 (建议记住, 因为有一年考试考了“用狄利克雷判别法证明.....”), 但是这个定理非常强大! 可以解决很多收敛性问题!

判断以下函数收敛性

1. $\int_0^{+\infty} \frac{\sin x}{x^p} dx$
2. $\int_1^{+\infty} \frac{1}{x \ln x} dx$

*瑕积分：把无穷积分的所有“无穷”部分换成瑕点！

$$\lim_{b \rightarrow +\infty} \int_a^b f(x)dx = I \Rightarrow \lim_{b \rightarrow b_0} \int_a^b f(x)dx = I$$

$$\forall \epsilon > 0, \exists N, \forall x_1, x_2 > N, |\int_{x_1}^{x_2} f(x)dx| < \epsilon \Rightarrow \forall \epsilon > 0, \exists \delta, \forall x_1, x_2 \in [a, a + \delta], |\int_{x_1}^{x_2} f(x)dx| < \epsilon$$

若积分以 a 为瑕点 (a 为上下界), 那么作换元 $t = \frac{1}{x-a}$ 即可转化为无穷积分

若瑕点 n 出现在中间, 那积分 \int_a^b 转化为 $\int_a^n + \int_n^b$ 两个瑕积分的和

Note

是不是以为 $\int_{-1}^1 \frac{1}{x} dx$ 是 0? 现在再看看呢?

无穷积分和瑕积分的计算与定积分类似, 且相对简单。方法比较唯一, 就是使用牛顿-莱布尼茨公式。因此不做赘述。

附录I: 常见不定积分的公式速查

基础版

$$(x^{n+1})' = (n+1)x^n \Leftrightarrow \int x^n dx = \frac{x^{n+1}}{n+1} + C$$

$$(\ln x)' = \frac{1}{x} \Leftrightarrow \int \frac{1}{x} dx = \ln|x| + C$$

$$(a^x)' = a^x \ln a \Leftrightarrow \int a^x dx = \frac{a^x}{\ln a} + C \therefore \int e^x dx = e^x + C$$

$$(\sin x)' = \cos x, (\cos x)' = -\sin x \Leftrightarrow \int \cos x dx = \sin x + C, \int \sin x dx = -\cos x + C$$

$$(\tan x)' = \frac{1}{\cos^2 x} \Leftrightarrow \int \frac{1}{\cos^2 x} dx = \tan x + C, \text{即 } \int \sec^2 x dx = \tan x + C$$

$$(\cot x)' = -\frac{1}{\sin^2 x} \Leftrightarrow \int \frac{1}{\sin^2 x} dx = -\cot x + C, \text{即 } \int \csc^2 x dx = -\cot x + C$$

$$(\arcsin x)' = \frac{1}{\sqrt{1-x^2}} \Leftrightarrow \int \frac{1}{\sqrt{1-x^2}} dx = \arcsin x + C$$

$$(\arctan x)' = \frac{1}{1+x^2} \Leftrightarrow \int \frac{1}{1+x^2} dx = \arctan x + C$$

进阶版

$$\int \sec x dx = \ln |\sec x + \tan x| + C$$

$$\int \csc x dx = \ln |\csc x - \cot x| + C$$

附录II：可积理论

前提条件

$f(x)$ 在 $[a, b]$ 上可积则必有界

还有闭区间上的无界函数？只要函数不连续其实就可以！

证明：作分割 Δ ，则必在分割的一部分中函数无界，记为 Δ_i

$$\text{设 } G = \left| \sum_{k \neq i} f(\xi_k) \Delta x_k \right|$$

$$\forall M > 0, \text{ 在 } \Delta_i \text{ 中 } \exists \xi_i, \text{ s.t. } |f(\xi_i)| > \frac{M+G}{\Delta x_i}$$

$$\left| \sum_{i=1}^n f(\xi_k) \Delta x_k \right| > \left| \sum_{k \neq i} f(\xi_k) \Delta x_k \right| - |f(\xi_i) \Delta x_i| = \left| \frac{M+G}{\Delta x_i} \Delta x_i - G \right| = M$$

即任意 M 都存在作和是大于 M 的取值，积分无界

满足了前提条件之后，还有什么要求呢？

达布上下和

$$\text{对分割 } \Delta, \text{ 记 } M(\Delta) = \sum_{i=1}^n \sup f(\Delta_i) \Delta x_i, m = \sum_{i=1}^n \inf f(\Delta_i) \Delta x_i$$

定积分里面的分割“作和”中“和”是任意的。经过这样的规定后，我们把最大和最小的和找了出来。

我们不断对分割加细，就是在原有的分割中加入一个分点，记这样操作后的分割为 $\Delta^1, \Delta^2, \Delta^3, \dots, \Delta^k$ ，那么数列 $\{M(\Delta^n)\}, \{m(\Delta^n)\}$ 具有什么样的性质？

黎曼可积条件

$$\inf M(\Delta) = \lim_{\|\Delta\| \rightarrow 0} M(\Delta) = \lim_{\|\Delta\| \rightarrow 0} m(\Delta) = \sup m(\Delta)$$

上和的下界等于下和的上界，分割最大值和最小值取出来作和是十分相近的。这就十分自然了。对应的，这个极限就是积分。

想起来 $f(x) = x$ 在0到1的积分吗，当时我们是不是取最大值和最小值算出来的极限都是 $\frac{1}{2}$ ？

等价的判定条件

$$\forall \epsilon > 0, \exists \Delta, \text{ s.t. } M(\Delta) - m(\Delta) < \epsilon$$

$$\Leftrightarrow \sum_{i=1}^n (\sup f(\Delta_i) - \inf f(\Delta_i)) \Delta x_i < \epsilon, \text{ 记作 } \sum_{i=1}^n \omega_i \Delta x_i < \epsilon$$

Example

$$R(x) = \begin{cases} \frac{1}{q} & \text{if } x = \frac{p}{q}, x \text{ 为既约分数} \\ 0 & \text{if } x=0,1 \text{ or } x \in \mathbb{R} \setminus \mathbb{Q} \end{cases}, \text{ 判断其可积性}$$