

УДК 517.98

НЕСТАНДАРТНАЯ ТЕОРИЯ КЛАССОВ

В. П. Андреев, Е. И. Гордон

1. Введение

В работе предлагается новая система аксиом нестандартной теории множеств — нестандартная теория классов (NCT), которая строится совершенно аналогично известной теории внутренних множеств (IST) Э. Нельсона [8]. Отличие состоит в том, что NCT представляет собой расширение теории классов (NBG) фон Неймана — Бернаиса — Гёделя, в то время, как IST — расширение теории Цермело — Френкеля (ZFC). Кроме того, мы пользуемся не IST, а принадлежащей В. Кановею и М. Рейкену [7] теорией ограниченных множеств (BST), которая отличается от IST добавлением *аксиомы ограниченности*

$$\forall x \exists^{\text{st}} y \quad x \in y$$

и необходимой модификацией принципа идеализации (принцип идеализации IST очевидно противоречит аксиоме ограниченности). Ясно, что теории BST достаточно для приложений, в то же время многие логические рассуждения в ней существенно проще.

Наличие классов позволяет формализовать в рамках NCT различные конструкции, использующие внешние множества, что невозможно в IST. В частности, одной из аксиом NCT является аксиома насыщенности, играющая исключительно важную роль в приложениях нестандартного анализа. От других известных теорий внешних множеств [2, 5, 6] NCT отличается естественностью и простотой. В частности, она содержит лишь конечное число аксиом — принципы переноса, идеализации и стандартизации Э. Нельсона формулируются здесь в виде отдельных аксиом, а не аксиомных схем.

Язык теории NCT получается добавлением к языку NBG одноместного предикатного символа St ($\text{St}X$) — читается « X — стандартный класс». Переменные, принимающие значения произвольных классов, обозначаются заглавными латинскими буквами, а переменные, принимающие значения множеств (т. е. классов, которые входят как элементы в какие-нибудь другие классы) — строчными. Внутренние классы определяются как сечения стандартных классов множествами. При таком определении сами множества являются внутренними классами, поскольку представляют собой сечения стандартного класса \in . Если внутренний класс (в частности, внутреннее множество) X представляет собой сечение стандартного класса множеством p , то говорят, что X стандартен относительно p , или p -стандартен. Это понятие относительной стандартности в рамках теории IST было впервые введено в статье [3], где, в частности, было доказано, что принцип переноса и импликация «слева-направо» в принципе идеализации остаются справедливыми,

если заменить все вхождения предиката стандартности в них, на предикат стандартности относительно произвольного, но фиксированного для каждой конкретной формулы множества p . Это остается справедливым и для теории NCT (см. ниже теорему 3).

Как уже отмечалось, все множества в рассматриваемой теории — внутренние. Внешние объекты являются собственными классами. При этом, как и в Альтернативной теории множеств (AST) П. Вopenки [9], здесь возможны подклассы множеств, которые не являются множествами (аксиома выделения истинна только для внутренних множеств). Следуя П. Вopenке, мы называем их полумножествами. Теория NCT имеет и некоторые другие свойства AST. В частности, в ней справедлива теорема о том, что множество стандартно-конечно (т. е. его мощность есть стандартное натуральное число) в том и только том случае, когда оно не содержит подполумножеств.

Разумеется, тот факт, что собственные классы не являются элементами других классов, несколько ограничивает выразительные возможности теории NCT. В частности, в ней не удастся в полном объеме формализовать конструкцию нестандартной оболочки внутреннего нормированного пространства E . В самом деле, элементами этой нестандартной оболочки являются классы эквивалентности внешнего подкласса ограниченных элементов E по внешнему отношению бесконечной близости в E . Но поскольку эти классы — внешние, то не существует класса, содержащего их в качестве элементов. Для того же, чтобы рассматривать нестандартную оболочку E , как класс, состоящий из представителей указанных классов эквивалентности, нужно добавить к NCT более сильную форму аксиому выбора, утверждающую, например, возможность такого вполне упорядочения полумножества, при котором каждый *подкласс* этого полумножества имеет наименьший элемент. Однако (см. параграф 3 ниже), такая аксиома не может быть добавлена к NCT без противоречия. В разделе 3 доказано, что таким образом могут быть вполне упорядочены лишь классы, для которых существует биекция на полумножество стандартных элементов некоторого стандартного множества, а полумножество ограниченных элементов внутреннего нормированного пространства таковым не является. С другой стороны в NCT может быть формализовано и доказано утверждение, равносильное теореме о полноте нестандартной оболочки. Речь идет об утверждении о том, что всякая внешняя, т. е. занумерованная стандартными натуральными числами последовательность e_n элементов E S -фундаментальна (т. е. $\forall^{\text{st}} \varepsilon > 0 \exists^{\text{st}} n_0 \forall^{\text{st}} m, n > n_0 \|e_n - e_m\| < \varepsilon$), то она имеет S -предел в E (т. е. $\exists e \in E \forall^{\text{st}} \varepsilon > 0 \exists^{\text{st}} n_0 \forall^{\text{st}} n > n_0 \|e_n - e\| < \varepsilon$). Аналогично в рамках NCT могут быть формализованы содержащиеся в [4] рассмотрения, связанные с построением топологических групп, как фактор-групп гиперконечных групп по внешнему нормальному делителю.

2. Аксиоматика и основные свойства NCT

Язык NCT — это язык исчисления предикатов с равенством, содержащий один бинарный предикатный символ \in и один унарный предикатный символ St . Формулы языка NCT будем обозначать греческими буквами. Переменные обозначаются заглавными латинскими буквами и интерпретируются как классы. Как обычно, запись $\phi(X_1, \dots, X_n)$ означает, что свободные переменные формулы ϕ содержатся среди X_1, \dots, X_n .

Запись $S(X_1, \dots, X_n) \rightleftharpoons \phi(X_1, \dots, X_n)$ означает, что выражение $S(X_1, \dots, X_n)$ служит сокращением для $\phi(X_1, \dots, X_n)$.

Класс X , удовлетворяющий формуле $\text{Set}(X) \rightleftharpoons \exists Y (X \in Y)$, называется множеством. Множества и только они обозначаются строчными латинскими буквами.

Аксиома объемности:

$$\forall X \forall Y (X = Y \longleftrightarrow \forall u (u \in X \longleftrightarrow u \in Y)).$$

Если $\phi(x, X_1, \dots, X_n)$ — формула НСТ и для некоторого класса X имеет место

$$\forall x (x \in X \longleftrightarrow \phi(x, X_1, \dots, X_n)),$$

то будем писать $X = \{x : \phi(x, X_1, \dots, X_n)\}$.

Аксиома пары:

$$\forall u \forall v \exists x (x = \{w : w = u \vee w = v\}).$$

Как обычно, множество x , фигурирующее в аксиоме пары обозначается через $\{u, v\}$. При этом

$$\{u\} = \{u, u\},$$

$$\langle u, v \rangle = \{\{u\}, \{u, v\}\},$$

$$\langle u_1, \dots, u_n \rangle = \langle \langle u_1, \dots, u_{n-1} \rangle, u_n \rangle,$$

$$\text{Fnc } R \equiv \forall x \forall y \forall z ((\langle x, y \rangle \in R \& \langle x, z \rangle \in R \rightarrow y = z).$$

Аксиома объединения:

$$\forall x \exists y \forall u (u \in x \longleftrightarrow u \subseteq y).$$

Аксиома степени:

$$\forall x \exists y \forall u (u \in y \longleftrightarrow u \subseteq x).$$

Аксиома бесконечности:

$$\exists x (\exists y \in x \forall u (u \notin y) \& \forall u \in x (u \cup \{u\} \in x)).$$

Аксиома выбора:

$$\forall x (x \neq \emptyset \& \forall u \in x (u \neq \emptyset) \longrightarrow \exists f (\text{Fnc } f \& \forall u \in x \exists v (\langle u, v \rangle \in f \& v \in u)).$$

Аксиома регулярности:

$$\forall x \exists u \in x (u \cap x = \emptyset).$$

Аксиома собирания:

$$\forall V \forall x \exists y \forall u \in x (\exists v (\langle u, v \rangle \in V) \longrightarrow \exists v \in y (\langle u, v \rangle \in V)).$$

Ниже используются следующие сокращения:

$$\exists^{\text{st}} x \phi \equiv \exists x (\text{St}(x) \& \phi),$$

$$\forall^{\text{st}} x \phi \equiv \forall x (\text{St}(x) \longrightarrow \phi).$$

Аксиома ограниченности:

$$\forall x \exists^{\text{st}} z (x \in z).$$

Аксиома переноса:

$$\mathbf{T} : \forall^{\text{st}} X (\exists x (x \in X) \longrightarrow \exists^{\text{st}} x (x \in X)).$$

Аксиома стандартизации:

$$\mathbf{S} : \forall X \exists^{\text{st}} Y \forall^{\text{st}} x (x \in Y \longleftrightarrow x \in X).$$

Отправляясь от пустого множества, по аксиоме стандартизации можно получить стандартный класс L , не содержащий стандартных элементов. По аксиоме переноса $L = \emptyset$, т. е. пустое множество стандартно.

Формула называется *предикативной*, если в ней связаны только переменные, ограниченные множествами и предикат стандартности присутствует только в составе внешних кванторов, т. е. все вхождения кванторов и предиката стандартности имеют вид $\exists x$, $\exists^{\text{st}} x$, $\forall x$, $\forall^{\text{st}} x$. Заметим, что подформулу $\text{St}(x)$ можно заменить на $\exists^{\text{st}} y (y = x)$.

Пусть p — произвольное множество. Класс X называется p -стандартным ($\text{st}_p X$), если он является p -сечением некоторого стандартного класса Y , т. е. $\exists^{\text{st}} Y (X = Y''p)$, где $Y''p = \{v : \langle p, v \rangle \in Y\}$.

Класс X называется *внутренним* ($\text{int} X$), если он p -стандартен для некоторого p .

Аксиома существования классов:

Пусть формула $\phi(x_1, \dots, x_n, Y_1, \dots, Y_m)$ предикативна. Тогда

1. для произвольных классов Y_1, \dots, Y_m существует класс

$$\mathcal{T} = \{\langle x_1, \dots, x_n \rangle : \phi(x_1, \dots, x_n, Y_1, \dots, Y_m)\};$$

2. Если формула ϕ — внутренняя и классы Y_1, \dots, Y_m стандартны, то \mathcal{T} есть стандартный класс.

ЗАМЕЧАНИЕ. Точно также, как и для теории NBG, вместо приведенной здесь схемы аксиом существования классов достаточно принять в качестве аксиом лишь конечное число ее частных случаев, после чего данная схема аксиом в полном объеме может быть доказана. Таким образом теория НСТ является конечно аксиоматизируемой.

Из аксиомы существования классов легко вытекает следующее

Предложение 1. *Если в условиях аксиомы существования классов формула ϕ и классы Y_1, \dots, Y_n — внутренние, то \mathcal{T} есть внутренний класс. При этом, если все Y_i p -стандартны для некоторого фиксированного множества p , то класс \mathcal{T} также p -стандартен.*

Введем теперь следующие обозначения:

$$\begin{aligned} \mathbb{U} &= \{x : x = x\} = \{x : x \notin \emptyset\}, \\ \mathbb{E} &= \{x : \exists u \exists v (x = \langle u, v \rangle \& u \in v)\}, \\ \mathbb{S} &= \{x : \text{St}(x)\}, \\ \neg X &= \{x : x \notin X\}, \\ X \cap Y &= \{x : x \in X \& x \in Y\}, \\ \text{dom} X &= \{u : \exists v (\langle u, v \rangle \in X)\}, \\ X \times Y &= \{\langle u, v \rangle : u \in X \& v \in Y\}. \end{aligned}$$

Согласно аксиомам существования классов совокупности \mathbb{U} и \mathbb{E} суть стандартные классы, \mathbb{S} есть класс и для любых классов X и Y совокупности $\neg X$, $X \cap Y$, $\text{dom} X$, $X \times \mathbb{U}$ суть классы, стандартные, если стандартны X и Y .

Любое множество x является x -стандартным и, следовательно, внутренним, поскольку $x = \mathbb{E}^{-1}x$. Любой стандартный класс X — внутренний, так как $X = (\{\emptyset\} \times X)''\emptyset$.

Следующие две аксиомы выражают свойства внутренних классов.

Аксиома выделения:

$$\forall^{\text{int}} X \forall X \exists y \forall u (u \in y \longleftrightarrow u \in x \ \& \ u \in X).$$

Аксиома идеализации:

$$\forall^{\text{int}} X \forall^{\text{st}} a_0 (\forall^{\text{st fin}} \subseteq a_0 \exists x \forall a \in c(\langle x, a \rangle \in X) \longleftrightarrow \exists x \forall^{\text{st}} a \in a_0(\langle x, a \rangle \in X)).$$

Нижеследующая теорема непосредственно вытекает из аксиомы существования классов и предложения 1.

Теорема 1. *Справедливы следующие утверждения:*

1. Пусть ϕ — внутренняя предикативная формула. Тогда

$$\forall^{\text{int}} X_1 \dots \forall^{\text{int}} X_n \forall x \exists y \forall u (u \in y \longleftrightarrow y \in x \ \& \ \phi(x, X_1, \dots, X_n)).$$

В частности, выполняется схема аксиом выделения BST.

2. В NCT выполняются аксиомы стандартизации и идеализации BST.

3. Принцип переноса. Если ϕ — внутренняя предикативная формула, то

$$\forall^{\text{st}} X_1 \dots \forall^{\text{st}} X_n (\forall^{\text{st}} x \phi(x, X_1, \dots, X_n) \longrightarrow \forall x \phi(x, X_1, \dots, X_n)).$$

В частности, выполнена схема аксиом переноса BST.

Следствие 1. *Всякое доказуемое в BST предложение доказуемо и в NCT.*

Напомним, что аксиомы переноса, идеализации, стандартизации и выделения BST являются частными случаями соответствующих аксиом NCT, в которых классы определяются предикативными формулами с множественными свободными переменными (для аксиом выделения, переноса и идеализации эти формулы — внутренние.)

Предложение 2. *Если x и p — произвольные множества, то*

$$\text{st}_p x \longleftrightarrow \exists^{\text{st}} z (x = z''p) \longleftrightarrow \exists^{\text{st}} f (\text{Fnc } f \ \& \ x = f(p)).$$

◁ Пусть множество x p -стандартно. Тогда по аксиоме ограниченности и принципу переноса $x = z''p$ для некоторого стандартного z , функция $f = \{\langle q, z''q \rangle : q \in \text{dom } z\}$ стандартна и $f(p) = x$.

Наоборот, если функция f стандартна, то множество $f(p)$ будет p -сечением стандартного по принципу переноса множества $\{\langle q, u \rangle : u \in f(q)\}$. ▷

Теорема 2. *Пусть ϕ — внутренняя предикативная формула и p — произвольное множество. Тогда*

$$\forall^{\text{st}_p} X_1 \dots \forall^{\text{st}_p} X_n (\forall^{\text{st}_p} x \phi(x, X_1, \dots, X_n) \longrightarrow \forall x \phi(x, X_1, \dots, X_n)).$$

◁ Согласно предложению 1 достаточно доказать, что каждый непустой p -стандартный класс X содержит p -стандартный элемент.

Пусть $X = Y''p$, $\text{st } Y$ и $p \in r$, $\text{st } r$. По аксиомам собирания и выбора и теореме переноса найдется такая стандартная функция f , что

$$\forall q \in r (\exists y (\langle q, y \rangle \in Y) \longrightarrow \exists y (\langle q, y \rangle \in Y \cap f)).$$

Так как X непуст, $p \in \text{dom } f$ и $f(p)$ будет p -стандартным элементом X . ▷

Для произвольного класса C обозначим ${}^\circ C = C \cap \mathbb{S}$. Аксиома стандартизации постулирует существование для любого класса X стандартного класса Y со свойством ${}^\circ Y = {}^\circ X$. По принципу переноса такой стандартный класс единственен. Он обозначается через ${}^s X$.

Теорема 3. *Класс стандартен тогда и только тогда, когда его пересечение с каждым стандартным множеством есть стандартное множество.*

◁ Необходимость следует из аксиом существования классов и выделения. Докажем достаточность.

Пусть X — такой класс, что $\forall^{\text{st}} z \exists^{\text{st}} t (t = X \cap z)$. Положим $Y = {}^s \{x : x \in X\}$ и покажем, что $Y = X$. Благодаря аксиоме ограниченности для этого достаточно проверить, что для любого стандартного множества z имеет место равенство $z \cap X = z \cap Y$. По выбору Y

$${}^\circ(X \cap z) = {}^\circ X \cap {}^\circ z = {}^\circ Y \cap {}^\circ z = {}^\circ(Y \cap z). \quad (1)$$

Поскольку $X \cap z$ и $Y \cap z$ являются стандартными множествами, то по принципу переноса из (1) следует требуемое равенство. ▷

Предложение 3. *Множество является стандартным и конечным тогда и только тогда, когда все его элементы стандартны.*

◁ По принципу идеализации имеем:

$$\text{st fin } x \longleftrightarrow \exists^{\text{st fin}} y \subseteq x \forall a \in x \exists b \in y (a = b) \longleftrightarrow \forall a \in x \exists^{\text{st}} b \in x (a = b). \quad \triangleright$$

Множество называется *стандартно-конечным*, если его мощность есть стандартное натуральное число.

Теорема 4. *Множество является стандартно-конечным, если и только если все его подклассы суть множества.*

◁ Пусть x — некоторое множество, $|x| = \alpha$ и $f : \alpha \rightarrow x$ — взаимнооднозначная функция.

Если x не является стандартно-конечным, то по принципу переноса $\forall^{\text{st}} n \in w (\alpha > n)$. Для класса $I = \{f(n) : n \in {}^\circ w\}$ мы можем записать:

$$\forall^{\text{st fin}} s \subseteq w \exists k \in w \forall n \in s (f(k) \in I \& n < k).$$

Если бы I был множеством, то нашлось бы такое $k \in w$, что $f(k) \in I$ и $\forall^{\text{st}} n \in w (n < k)$, что невозможно, так как $f(k) \in I$ только для стандартных k в силу взаимнооднозначности f .

Пусть теперь x стандартно-конечно и $X \subseteq x$. Рассмотрим класс $T = \{n \in \alpha : f(n) \in X\}$. По принципам стандартизации и переноса существует множество $t = {}^s T$, $t \subseteq \alpha$. Так как, по предложению 3, $\alpha \subseteq \mathbb{S}$, имеет место равенство $t = {}^\circ t = {}^\circ T = T$. Тогда $X = \{f(n) : n \in t\}$ есть множество. ▷

Назовем *P -монадой* $\mu_p(x)$ множества x пересечение всех p -стандартных классов, содержащих x . Поскольку дополнение к стандартному классу есть стандартный класс, p -монады двух произвольных множеств либо не пересекаются, либо совпадают. По предложению 2 имеем:

$$\mu_p(x) = \{y : \forall^{\text{st } p} z (y \in z \longleftrightarrow x \in z)\}.$$

Если множество p стандартно, то класс $\mu_p(x)$ будем называть *монадой* множества x и обозначать $\mu(x)$. Очевидно, $\mu(x) = \cap \{a \in \mathbb{S} : x \in a\}$.

Пусть x — произвольное множество. По аксиоме ограниченности $x \in x_0$, $\text{st } x_0$. Используя перенос, нетрудно показать, что $u = {}^s \{a \subseteq x_0 : x \in a\}$ есть стандартный ультрафильтр, причем $\cap^\circ u = \mu(x)$. Наоборот, если u — произвольный стандартный ультрафильтр, то по принципам переноса и идеализации $\cap^\circ u \neq \emptyset$ и $\forall x \in \cap^\circ u (\mu(x) = \cap^\circ u)$.

Класс $\cap^{\circ}u$ называется гнездом ультрафильтра u и обозначается $\nu(u)$. Для обозначения класса всех ультрафильтров будем использовать сокращение Ult , для множества всех ультрафильтров на множестве x — $\text{Ult}(x)$.

Предложение 4. Для произвольных множеств x и p

$$\mu_p(x) = \mu(\langle p, x \rangle)''p.$$

◁ Используя предложение 2, получим:

$$y \in \mu(\langle p, x \rangle)''p \longleftrightarrow \langle p, y \rangle \in \mu(\langle p, x \rangle) \longleftrightarrow \forall^{\text{st}} z (\langle p, x \rangle \in z \longleftrightarrow \langle p, y \rangle \in z) \longleftrightarrow y \in \mu_p(x). \triangleright$$

Класс X назовем p -насыщенным, если вместе с каждым множеством он содержит всю p -монаду этого множества.

Предложение 5. Множество x является p -стандартным тогда и только тогда, когда оно p -насыщено.

◁ Пусть x p -насыщено. Возьмем произвольный элемент $u \in x$ и покажем, что u принадлежит p -сечению некоторого стандартного множества, включенному в x . Действительно, если допустить противное, то

$$\forall^{\text{st}} z (u \in z''p \longrightarrow \exists v \in z''p (v \notin x)). \quad (2)$$

Область изменения z в формуле 2 можно ограничить стандартным множеством $\{t : t \subseteq \cup x_0\}$, где $x_0 \ni x$ стандартно. По идеализации получим:

$$\exists v \notin x \forall^{\text{st}} z (u \in z''p \longrightarrow v \in z''p),$$

что противоречит включению $\mu_p(u) \subseteq x$.

Таким образом, мы имеем: $\forall u \in x \exists^{\text{st}} z (u \in z''p \subseteq x)$. Снова применив принцип идеализации, получим такое стандартное конечное множество z_0 , что $\forall u \in x \exists z \in z_0 (u \in z''p \subseteq x)$. Нетрудно проверить, что x будет p -сечением стандартного множества $\cup z_0$. \triangleright

Следствие 2. Для любых множеств x и p

$$\mu_p(x) = \{x\} \longleftrightarrow \text{textst}_p x.$$

◁ Импликация справа налево очевидна. Если же $\mu_p(x) = \{x\}$, то множество $\{x\}$ p -насыщено и, значит, p -стандартно. Тогда по переносу x также будет p -стандартным. \triangleright
Аксиома насыщенности:

$$\forall X \exists p \forall x \in X (\mu_p(x) \subseteq X),$$

т. е. всякий класс является p -насыщенным для некоторого множества p .

Для произвольных класса $D \subseteq \text{Ult}$ и множества p обозначим

$$\text{Pcls}(D, p) = \bigcup_{u \in {}^{\circ}D} \nu(u)''p.$$

Полумножествами называются подклассы множеств:

$$\text{Sms } X \Leftrightarrow \exists^{\text{st}} z (X \subseteq z).$$

Теорема 5. Пусть X — произвольный класс. Тогда найдутся такой стандартный класс $D \subseteq \text{Ult}$ и множество p , что

$$X = \text{Pcls}(D, p). \quad (3)$$

Если X — полумножество, то D можно выбрать множеством.

◁ Пусть X — p -насыщенный класс. Положим $D =^s \{u \in \text{Ult} : \nu(u)''p \subseteq X\}$. Тогда по предложению 4 выполняется (3).

Если $X \in z$, $\text{st } z$, то равенство (3) сохранится, если вместо D взять стандартное по принципу переноса множество $d = D \cap \text{Ult}(r \times z)$, где r — произвольное стандартное множество, содержащее p . ▷

Таким образом, всякое полумножество в NCT оказывается определяемым некоторой предикативной \sum_2^{st} -формулой.

Следствие 3. Если в формуле все кванторы ограничены полумножествами, то она она эквивалентна некоторой предикативной формуле.

◁ Заменяем все подформулы вида $\text{st } X$ на $\forall^{\text{st}} s \exists^{\text{st}} t (t = X \cap s)$, а подформулы вида $\exists X (Sms X \rightarrow \phi(X, \dots))$ на $\exists^{\text{st}} d \exists p \phi(\text{Pcls}(d, p), \dots)$. ▷

Следующая теорема является принципом насыщенности в его традиционной формулировке. Отметим, что в отличие от NCT, ни в IST, ни в BST эта теорема не может быть не только доказана, но даже и сформулирована.

Теорема 6. Пусть класс X и стандартное множество z_0 таковы, что $\forall^{\text{st}} x \in z_0 \exists y (\langle x, y \rangle \in X)$. Тогда найдется такая функция-множество f , что $\forall^{\text{st}} x \in z_0 (\langle x, f(x) \rangle \in X)$.

◁ По аксиомам собирания и ограниченности найдется стандартное множество t такое, что $\forall x \in z_0 (\exists y (\langle x, y \rangle \in X) \rightarrow \exists y \in t (\langle x, y \rangle \in X))$. Пусть класс X p -насыщен. Если $\langle x, y \rangle \in X$ и x стандартно, то $\forall y' \in \mu(y) (\langle x, y' \rangle \in X)$, поскольку $\mu_p(\langle x, y \rangle) = \{x\} \times \mu_p(y)$. Положим $d =^s \{\langle x, u \rangle \in z \times \text{Ult}(t) : \{x\} \times (\nu(u)''p) \subseteq X\}$. Аксиома выбора и принцип переноса позволяют выбрать такую стандартную функцию $h : z_0 \rightarrow \text{Ult}(t)$, что $\forall x \in z_0 (\langle x, h(x) \rangle \in d)$. Имеем:

$$\forall^{\text{st}} \text{fin } z \in z_0 \exists f \forall x \in z \forall^{\text{st}} a \in h(x) (\text{Fnc}(f) \ \& \ f(x) \in a).$$

По принципу идеализации получим такую функцию f , что $\forall^{\text{st}} x \in z (f(x) \in \nu(h(x)))$. Нетрудно видеть, что f — искомая функция. ▷

3. Непротиворечивость NCT

Настоящий раздел посвящен доказательству следующей теоремы.

Теорема 7. Всякое предикативное предложение, доказуемое в NCT, доказуемо и в BST.

Мы покажем, что всякая модель BST изоморфно вкладывается в некоторую модель NCT в качестве универсума всех множеств, откуда по теореме о полноте следует доказываемое утверждение.

Рассмотрим произвольную модель $\mathfrak{M} = \langle M, \in^M, \text{st}^M \rangle$ теории BST. Пусть L есть обогащение языка BST элементами из M , рассматриваемыми как новые константные символы. Мы будем считать \mathfrak{M} моделью языка L , принимая за интерпретацию символа $a \in M$ само множество a . Множества из M , входящие в формулу языка L , будем называть ее параметрами.

Для всякой формулы ϕ языка L с одной свободной переменной обозначим $\lceil \phi \rceil := \{x : \mathfrak{M} \models \phi(x)\}$. Положим

$$N = \{\lceil \phi \rceil : \phi \text{ — формула языка } L \text{ с одной свободной переменной}\};$$

$$\text{Std} = \{\lceil \phi \rceil \in N : \phi \text{ — внутренняя формула со стандартными параметрами}\};$$

$$\text{Set}(a) = \lceil x \in a \rceil \text{ для любого } a \in M.$$

Для любых $p, q \in N$ определим

$$p \in^N q \iff \exists a \in M (p = \text{Set}(a) \ \& \ a \in q)$$

$$\text{st}^N p \iff p \in \text{Std}.$$

Предложение 6. Для любых $a, b \in M, p, q \in N$

1. $n \in^N q \Rightarrow \exists a \in M (p = \text{Set}(a))$;
2. $\text{Set}(a) = \text{Set}(b) \iff a = b$;
3. Если $p = \text{Set}(a), q = \text{Set}(b)$, то $p \in^N q \iff a \in^M b$;
4. Если $p = \text{Set}(a)$, то $\text{st}^N p \iff \text{st}^M a$.

\triangleleft 1. верно по определению отношения \in^N .

2. вытекает из справедливости аксиомы экстенциональности в \mathfrak{M} .

3. следует из 1) по определению отношения \in^N .

4. По определению st^N имеем: $p = \{b : \mathfrak{M} \models b \in a\} = \{b : \mathfrak{M} \models \phi(b)\}$, где ϕ — внутренняя формула со стандартными параметрами. Следовательно, $\mathfrak{M} \models \forall x (x \in a \iff \phi(x))$. Из того, что в \mathfrak{M} выполнена схема аксиом переноса, следует, что $\mathfrak{M} \models \text{st} a$, т. е. $\text{st}^M a$.

Наоборот, если $\text{st}^M a$, то $p = [x \in a] \in \text{Std}$. \triangleright

Теперь очевидно следующее

Предложение 7. Отображение Set изоморфно вкладывает \mathfrak{M} как модель языка L в модель $\mathfrak{N} = \langle N, \in^N, \text{st}^N \rangle$, причем для всякого $p \in N \mathfrak{N} \models \exists X (p \in X) \Rightarrow \exists a \in M (p = \text{Set}(a))$.

Предложение 7 показывает, что класс p является множеством в \mathfrak{N} в том и только том случае, когда $p = \text{Set}(a)$ для некоторого $a \in M$, т. е. \mathfrak{M} действительно вкладывается в \mathfrak{N} как универсум всех множеств.

Осталось проверить выполнимость аксиом НСТ в \mathfrak{M} .

Из предложения 7 следует, что аксиомы НСТ, являющиеся предикативными предложениями, выполняются в \mathfrak{N} , если они истинны в BST. Это верно по отношению к аксиомам пары, объединения, степени, бесконечности, выбора, регулярности и ограниченности.

Аксиома экстенциональности выполняется в \mathfrak{N} , благодаря построению отношения \in^N .

Если ϕ — формула языка L , то совокупность $\{x : \phi(x, x_1, \dots, x_n)\}$ будем обозначать через C_ϕ .

Пусть $\Phi(X_1, \dots, X_n)$ — предикативная формула, а $\phi_1(x, x_1, \dots, x_m), \dots, \phi_n(x, x_1, \dots, x_m)$ — формулы языка L , свободные переменные которых не участвуют в построении Φ . Обозначим через $\Phi(C_{\phi_1}, \dots, C_{\phi_n})$ формулу, которая получается из $\Phi(X_1, \dots, X_n)$ заменой

1. всех вхождений атомарных формул вида $y \in X_j$ на $\phi_j(y, x_1, \dots, x_m)$;
2. всех вхождений атомарных формул вида $X_i \in X_j$ на

$$\exists x (\forall y (y \in x \iff \phi_i(y, x_1, \dots, x_m)) \ \& \ \phi_j(x, x_1, \dots, x_m));$$

3. всех вхождений атомарных формул вида $X_i \in X_j$ на

$$\forall x (\phi_i(x, x_1, \dots, x_m) \iff \phi_j(x, x_1, \dots, x_m));$$

4. всех вхождений атомарных формул вида $X_i \in x$ на

$$\forall y (y \in x \iff \phi_i(y, x_1, \dots, x_m)).$$

Свободными переменными (параметрами) формулы $\Phi(C_{\phi_1}, \dots, C_{\phi_n})$ являются свободные переменные (параметры) формул ϕ_1, \dots, ϕ_n .

Предложение 8. Если Φ — предикативная формула, и $C_{\phi_1}, \dots, C_{\phi_n}$ — совокупности без свободных переменных, то

$$\mathfrak{N} \models \Phi([\phi_1], \dots, [\phi_n]) \iff \mathfrak{M} \models \Phi(C_{\phi_1}, \dots, C_{\phi_n}).$$

◁ Доказательство проводится индукцией по построению Φ с использованием предложения 6. ▷

Заметим, что аксиомы NCT, не являющиеся предикативными предложениями, имеют вид

$$Q_1 X Q_2 Y Q Z \Psi(X, Y, Z), \quad (*)$$

где $Q_1, Q_2 \in \{\forall, \forall^{\text{st}}\}$, $Q \in \{\exists, \exists^{\text{st}}\}$, и Ψ — предикативная формула.

Будем говорить, что предложение вида (*) истинно в BST для классов, если для произвольных формул $\phi_1(x, u_1, \dots, u_l)$ и $\phi_2(x, v_1, \dots, v_m)$ языка BST, внутренних, если соответствующие кванторы внешние, можно указать такую формулу $\phi(x, w_1, \dots, w_n)$ языка BST, внутреннюю, если квантор Q внешний, что предложение

$$Q_1 u_1 \cdots Q_1 u_l Q_2 v_1 \cdots Q_2 v_m Q w_1 \cdots Q w_n \Psi(C_{\phi_1}, C_{\phi_2}, C_{\phi})$$

истинно в BST. При этом предполагается, что переменные u_i, v_i, w_i не участвуют в построении формулы Ψ .

Предложение 9. Пусть предложение Φ имеет вид (*). Тогда, если Φ истинно в BST для классов, то Φ выполняется в \mathfrak{N} .

◁ Рассмотрим случай, когда в Φ все кванторы по классам — внешние. Возьмем произвольные \mathfrak{N} -стандартные элементы $[\phi_1], [\phi_2] \in N$. Из того, что Φ истинно в BST для классов, следует, что найдется такая внутренняя формула ϕ языка L с \mathfrak{M} -стандартными параметрами и одной свободной переменной, что $\mathfrak{M} \models \Psi(C_{\phi_1}, C_{\phi_2}, C_{\phi})$. Таким образом, мы имеем: $\text{st}^N[\phi]$ и $\mathfrak{N} \models \Psi([\phi_1], [\phi_2], [\phi])$ по предложению 8, что и требовалось. ▷

Нетрудно доказать истинность в BST для классов аксиом переноса, существования классов, регулярности, выделения и идеализации. Аксиомы стандартизации, собирания и насыщенности требуют отдельного рассмотрения.

Мы будем пользоваться определениями, обозначениями и доказанными нами фактами о монадах и ультрафильтрах, которые имеют место также и в BST. Кроме того, будет использована следующая теорема [1].

Теорема 8 (BST). Для любой формулы Φ с двумя переменными найдется такая внутренняя формула ϕ , что

$$\begin{aligned} \forall p \forall^{\text{st}} x (\Phi(x, p) \iff \forall^{\text{st}} U \in \text{Ult} (p \in \nu(U) \longrightarrow \phi(x, U))) \\ \iff \exists^{\text{st}} U \in \text{Ult} (p \in \nu(U) \& \phi(x, U))) \end{aligned}$$

Теорема 9. Аксиома стандартизации NCT верна в BST для классов.

◁ Пусть Φ — произвольная формула. Можно считать, что она имеет на более двух свободных переменных. Выберем согласно теореме 8 внутреннюю формулу ϕ , удовлетворяющую (4). Тогда, если множество p и ультрафильтр U таковы, что $p \in \nu(U)$, то

$$\forall^{\text{st}} x (\Phi(x, p) \iff \phi(x, U)).$$

Поскольку всякое множество принадлежит гнезду некоторого стандартного ультрафильтра, это доказывает истинность аксиомы стандартизации в BST для классов. ▷

Пусть U — ультрафильтр. Обозначим

$$\begin{aligned}\text{dom}[U] &= \{\text{dom}u : u \in U\}; \\ \text{ran}[U] &= \{\text{ran}u : u \in U\}.\end{aligned}$$

Используя принципы переноса и идеализации нетрудно показать, что для всякого ультрафильтра U $\text{dom}[U]$ и $\text{ran}[U]$ также являются ультрафильтрами, причем для любых множеств a и b

$$\begin{aligned}\langle a, b \rangle \in \nu(U) &\longrightarrow a \in \nu(\text{dom}[U]) \ \& \ b \in \nu(\text{ran}[U]); \\ a \in \nu(\text{dom}[U]) &\longrightarrow \exists b \in \text{ran}[U] (\langle a, b \rangle \in \nu(U)).\end{aligned}$$

Теорема 10. *Аксиома собирания истинна в BST для классов.*

◁ Пусть Φ есть формула с двумя свободными переменными. Согласно теореме 8 имеем для некоторой внутренней формулы ϕ :

$$\Phi(a, b) \longleftrightarrow \exists^{\text{st}} U \in \text{Ult} (\langle a, b \rangle \in \nu(U) \ \& \ \phi(U)).$$

Обозначим

$$\psi(V, W) = \exists U \in \text{Ult} (\text{dom}[U] = V \ \& \ \text{ran}[U] = W \ \& \ (U)).$$

По теореме собирания и принципу переноса BST для любого стандартного множества A найдется такое стандартное множество R , что

$$\forall V \in \text{Ult} (A) (\exists W \psi(V, W) \longrightarrow \exists W \in R \psi(V, W)).$$

Обозначим $Y = \cup \cup R$. Тогда по принципу переноса и свойствам гнезд ультрафильтров для всякого $a \in A$ будем иметь:

$$\begin{aligned}\exists b \Phi(a, b) &\longrightarrow \exists^{\text{st}} V \in \text{Ult} (A) \exists^{\text{st}} W \in \text{Ult} (a \in \nu(V) \ \& \ \psi(V, W) \longrightarrow \\ &\longrightarrow \exists^{\text{st}} V \in \text{Ult} (A) \exists^{\text{st}} W \in R (a \in \nu(V) \ \& \ \psi(V, W) \longrightarrow \\ &\longrightarrow \exists b \in Y \exists^{\text{st}} U (\langle a, b \rangle \in \nu(U) \ \& \ \phi(U) \longrightarrow \exists b \in Y \Phi(a, b)).\end{aligned}$$

Пусть теперь $\Psi(x, y, p)$ — произвольная формула. Для доказательства теоремы достаточно показать, что для любого p и всякого стандартного X найдется такое множество Y , что

$$\forall x \in X (\exists y \Psi(x, y, p) \longrightarrow \exists y \in Y \Psi(x, y, p)).$$

Фиксируем стандартные множества X и P . Положим $\Phi(a, b) \equiv \exists x \exists p (a = \langle x, p \rangle \ \& \ \Psi(x, b, p))$.

По доказанному найдется такое стандартное множество Y , что для любого $p \in P$ выполняется (5). Осталось применить аксиому ограниченности. ▷

Теорема 11. *Аксиома насыщенности истинна в BST для классов.*

◁ В силу теоремы 8 для всякой формулы Φ с двумя свободными переменными можно построить такую внутреннюю формулу ϕ , что

$$\Phi(x, p) \longleftrightarrow \exists^{\text{st}} U (\langle p, x \rangle \in \nu(U) \ \& \ \phi(U)),$$

откуда для любого множества p по предложению 4 получаем:

$$\forall x (\Phi(x, p) \longrightarrow \forall y \in \mu_p(x) \Phi(y, p)),$$

что и доказывает утверждение теоремы. ▷

Итак, все аксиомы NTC истинны в \mathfrak{N} , что и доказывает теорему 7.

4. Классы стандартных размеров

В этом разделе охарактеризованы классы, которые могут быть сильно вполне упорядочены, т. е. линейно упорядочены так, что каждый непустой подкласс имеет наименьший элемент. Отсюда, в частности, следует, что аксиома, утверждающая, что каждое множество может быть сильно вполне упорядоченно, противоречит основным аксиомам НСТ.

Буквы F, f, G, g, H, h со всевозможными индексами зарезервируем для обозначения функций. Определим

$$\text{Sat}_p X \rightleftharpoons X - p\text{-насыщенный класс.}$$

Обозначим $X''D = y : \exists x \in D (\langle x, y \rangle \in X)$.

Предложение 10. $\forall p \forall x \forall y (\text{dom} \mu_p(\langle x, y \rangle) = \mu_p(x))$.

Предложение 11. $\text{Sat}_p F \longrightarrow \forall^{\text{st}} x \in \text{dom}(F) (\text{textst}_p F(x))$.

\triangleleft Возьмем произвольную пару $\langle x, v \rangle \in F$. По предложению 10 $\mu_p(\langle x, v \rangle) = x \times \mu_p(v) \subseteq F$. Так как F — функция, $\mu_p(v) = v$. Значит, по следствию 2 $\text{textst}_p v$. \triangleright

Предложение 12 (Принцип продолжения). $\forall H \exists^{\text{int}} G \forall^{\text{st}} x \in \text{dom} H (F(x) = G(x))$.

При этом

a) если H — полумножество, то G можно выбрать множеством;

b) если H — p -насыщенна, то G можно выбрать p -стандартной.

\triangleleft Пусть $\text{Sat}_p H$. Обозначим $C = {}^s \{ \langle x, f \rangle : x \in \text{dom}(H) \& f(p) = H(x) \}$ и положим $G = \{ \langle x, f(p) \rangle : \langle x, f \rangle \in C \}$. По p -переносу функция G будет p -стандартной. Причем, если H — полумножество, то C можно выбрать множеством. \triangleright

Класс X имеет *стандартный размер*, если существует функция F и класс D такие, что $X = F'' \circ D$. По предложению 12 и стандартизации функцию F можно считать внутренней, а класс D — стандартным.

Предложение 13. Класс X имеет стандартный размер, если и только если все его элементы p -стандартны для некоторого фиксированного множества p .

\triangleleft Необходимость следует из предложения 11 и аксиомы насыщенности. Докажем достаточность. Пусть X состоит из p -стандартных множеств. Обозначим $D = {}^s \{ f : f(p) \in X \}$, $F = \{ \langle f, f(p) \rangle : f \in D \}$. Тогда по предложению 2 $X = F'' X$. \triangleright

Предложение 14. Если X — полупространство стандартного размера, то найдется взаимнооднозначная функция f и стандартное множество d такие, что $X = f'' \circ d$

\triangleleft Пусть $X \subseteq s$, $\text{st } s$. По предложению 13 все элементы X p -стандартны для некоторого $p \in p_0$, $\text{st } p_0$. Обозначим $d' = {}^s \{ g \in s^{p_0} : g(p) \in X \}$. Пусть d есть множество классов эквивалентности на множестве d' по отношению ${}^s \{ \langle g_1, g_2 \rangle \in d' \times d' : g_1(p) = g_2(p) \}$. Положим $f = \{ \langle t, f(p) \rangle : t \in d' \& f \in t \}$. Нетрудно проверить, что функция f и множество d — искомые. \triangleright

Предложение 15. Если множество x не является p -стандартным, то монада $\mu_p(x)$ включает некоторое множество бесконечно большой мощности.

\triangleleft По аксиоме ограниченности $x \in x_0$, $\text{st } x_0$. Согласно предложению 13 класс $S = \{ s : \text{textst}_p s \subseteq x_0 \& x \in s \}$ есть полумножество стандартного размера. По предложению 14 найдутся такие f и d , что $S = f'' \circ d$. Тогда $\mu_p(x) = \bigcap_{t \in {}^o d} f(t)$.

Пусть $\text{st fin } c \subseteq d$. Покажем, что мощность множества $v = \bigcap_{t \in c} f(t)$ бесконечно велика. Действительно, по предложению 3 $x \in v$. Если $|v| = n$, $\text{st } n$, то по принципу p -переноса

найдется p -стандартная функция h , отображающая множество $n \subseteq w$ на множество v . Тогда $x = h(i)$ для какого-то $i < n$, и x оказывается p -стандартным по p -переносу, что противоречит условию. Таким образом, мы имеем:

$$\forall^{\text{st fin}} c \subseteq d \exists v \forall t \in c \forall^{\text{st}} k (v \subseteq f(t) \& |v| > k).$$

По π -идеализации получаем:

$$\exists v (v \subseteq \mu_p(x) \& \forall^{\text{st}} k (|v| > k)),$$

что и требовалось. \triangleright

Предложение 16. Полумножество имеет стандартный размер тогда и только тогда, когда оно является подклассом некоторого множества любой наперед заданной бесконечно большой мощности.

\triangleleft Необходимость. Пусть $X = f''d$ и n — бесконечно большое натуральное число. Тогда, очевидно,

$$\forall^{\text{st fin}} c \subseteq d \exists z \forall t \in c (f(t) \in z \& |z| < n)$$

(можно взять $z = f''c$). По принципу идеализации получим: $\exists z (X \subseteq z \& |z| < n)$, что и требовалось.

Достаточность. Пусть $\text{Sat}_p X$. Из условия по предложению 15 X состоит только из p -стандартных элементов и, по предложению 13, имеет стандартный размер. \triangleright

Отношение \leq называется *сильно полным порядком* на классе X , если любой подкласс $Y \subseteq X$ имеет \leq -наименьший элемент.

Теорема 12. На полумноестве X можно задать сильно полный порядок, если и только если оно имеет стандартный размер.

\triangleleft Пусть X имеет стандартный размер. По предложению 14 найдется взаимнооднозначная функция f и стандартное множество d , такие, что $X = f''d$. По аксиоме выбора и принципу переноса существует полный стандартный порядок \leq на d . Докажем, что порядок \leq_X , индуцированный отображением f , сильно вполне упорядочивает X . Действительно, пусть $Y \subseteq X$. Обозначим через $a_0 \leq$ — минимальный элемент множества ${}^s\{a \in d : f(a) \in Y\}$. По принципу переноса $\text{st } a_0$. Нетрудно проверить, что $f(a_0)$ есть \leq_X — минимальный элемент класса Y .

Пусть \preceq есть сильно полный порядок на полумноестве X . Обозначим

$$T = \{f : \text{dom } f \in {}^\circ\text{Ord} \& \forall^{\text{st}} \alpha \in \text{dom } f (f(\alpha) = \min_{\preceq} (X - \{f(\beta) : \text{st } \beta < \alpha\}))\},$$

$$A = {}^s \{\alpha : \forall f \in T \forall g \in T (f(\alpha) = g(\alpha))\},$$

$$G = \{\langle \alpha, f(\alpha) \rangle : \alpha \in {}^\circ \& f \in T\}.$$

По принципу переноса и построению класса T , имеем: $\forall^{\text{st}} \alpha \in A (\alpha \subseteq A)$. Поэтому по принципу переноса, либо $A \in \text{Ord}$, либо $A = \text{Ord}$.

Нетрудно также показать, что функция G взаимнооднозначна и $\text{ran } G \subseteq X$. Класс $O = G''\text{Ord}$. Есть полумножество стандартного размера. По предложению 14 найдутся f и d такие, что $O = f''d$. Обозначим $H = \{\langle t, \alpha \rangle : t \in {}^\circ d \& f(t) = G(\alpha)\}$. По аксиоме собирания $A = \text{ran } H$ будет полумножеством.

Следовательно, $A \in \text{Ord}$. Но тогда, по построению T , $\text{ran } G = X$, и X имеет стандартный размер. \triangleright

Литература

1. Андреев П. В. О принципе стандартизации в теории ограниченных множеств // Вестн. Моск. ун-та, Сер. 1, Мат., Мех. 1997.—№ 1.—С. 68–70.
2. Ballard D., Hrabáček K. Standard Foundations for Nonstandard Analysis // J. Symb. Logic.—1992.—V. 57.—P. 471–478.
3. Гордон Е. И. Относительно стандартные элементы в теории внутренних множеств Е. Нельсона // Сиб. мат. журн.—1989, № 1.—С. 89–95.
4. Gordon E. I. Nonstandard Methods in Commutative Harmonic Analysis.—AMS, Providence, RI, 1997.
5. Hrabáček K. Nonstandard Set Theory // Amer. Math. Monthly.—1979.—V. 86.—P. 659–677.
6. Kawai T. Axiom System of Nonstandard Set Theory // Logic Symposia, Hakone.—1979, 1980, Berlin, a.o.: Springer, 1981.—P. 57–65.
7. Kanovei V., Reeken M. Integral Approach to External Sets and Universes // Studia Logica. Part I.—1995.—V. 55.—P. 227–235; Part II.—1995.—V. 55.—P. 347–376; Part III.—1996.—V. 56.—P. 293–322.
8. Nelson E. Internal Set Theory. A New Approach to Nonstandard Analysis // Bull. Amer. Soc.—1977.—V. 83.—P. 1165–1198.
9. Вopenка П. Математика в альтернативной теории множеств.—М.: Мир, 1983.