

Capitolo 5. Modelli di ZF

5.0 Riasumiamo brevemente alcune nozioni basilarie di teoria dei modelli.

Un linguaggio \mathcal{L} è un insieme di simboli $\mathcal{L} = \{R_i | i \in I\} \cup \{F_j | j \in J\} \cup \{c_k | k \in K\}$

ove gli R_i sono simboli di relazioni, F_j simboli di funzioni, c_k simboli di costanti.

Ad ogni R_i, F_j è associato un intero positivo (la arietà della relazione o funzione).

I termini e le formule del linguaggio \mathcal{L} sono stringhe di simboli scelti in \mathcal{L} , o

in un insieme numerabile V (detto insieme delle variabili) o tra i simboli logici:

$\vee, \wedge, \neg, \rightarrow, \leftrightarrow$ (connettivi logici) ; \exists, \forall (quantificatori) ; $=$ (uguale) ; $()$ (parentesi).

Precisamente una stringa è un termine se e solo se si ottiene nel modo seguente:

(i) t è una variabile o un simbolo di costante

(ii) $t = F_j(t_1, \dots, t_s)$ ove t_1, \dots, t_s sono termini ed F_j è una funzione s -aria

Una stringa φ è una formula atomica se e solo se si ottiene come segue:

(iii) $\varphi = R_i(t_1, \dots, t_n)$ ove t_1, \dots, t_n sono termini ed R_i è un simbolo di relazione n -aria

(iv) $\varphi = t_1 = t_2$ ove t_1, t_2 sono termini e

Una stringa φ è una formula se e solo se si ottiene come segue:

(v) φ è una formula atomica

(vi) $\varphi \equiv (\psi) \vee (x)$ ovvero $(\psi) \wedge (x)$ ovvero $(\psi) \rightarrow (x)$ ovvero $(\psi) \leftrightarrow (x)$ ovvero $\neg \psi$
ove ψ e x sono formule

(vii) $\varphi \equiv \exists x(\psi)$ ovvero $\forall x(\psi)$... ovre ψ è una formula e x una variabile

Se φ è una formula, definiamo le variabili libere in φ nel modo seguente.

(viii) Se φ è atomica, allora ogni variabile che compare in un termine comparsa
in φ è libera in φ ovunque essa compaia

(ix) Se φ si ottiene da ψ e x mediante la (vi), allora ogni variabile che compare
in ψ è libera in φ se e solo se lo è in ψ (ove era comparsa),
ed analogamente per le variabili che compaiono in x

(x) Se $\varphi \equiv \exists x(\psi) \circ \forall x(\psi)$ ogni variabile diversa da x è libera in φ se e solo se lo
è in ψ ove compare, mentre x non è libera in φ .

Una variabile che compare in φ si dice libera se lo è in qualche luogo di φ , vincolata

altrimenti. Una formula senza variabili libere si chiama proposizione o sentenza o enunciato.

Si chiama struttura o modello per \mathcal{L} una coppia $\mathcal{M} = (M, \mathcal{Y})$ ove M è un insieme
simboli di rel. s-aria, risp. di funz. n-aria, risp. dicost
(talvolta una classe) ed \mathcal{Y} un'applicazione che ad ogni espresso di \mathcal{L} associa una relazione o

A → A
risp. una funzione o risp. un elemento di A . In generale un modello per \mathcal{L} si nota per

distanza $\mathcal{M} = (M; S_i; i \in I; G_j; j \in J; a_k; k \in K)$ con ovvio significato delle notazioni.

Date due strutture per \mathcal{L} . $\mathcal{Q} = (A; S_i, G_j, a_k)$ $\mathcal{B} = (B; T_i, H_j, b_k)$ si dice che
 $\mathcal{Q} \subseteq \mathcal{B}$ (\mathcal{Q} è sottostruttura o rettangolo di \mathcal{B}) se $A \subseteq B$ e per ogni i, j, k

$$\text{si ha } S_i = T_i \cap A^{S_i}; \quad G_j = H_j|_{A^{G_j}}; \quad b_k = a_k$$

Un isomorfismo di \mathcal{Q} su \mathcal{B} è una biiezione $\sigma: A \rightarrow B$ t.c. $\forall i, j, k$

$$\text{si abbia } \forall a_1, \dots, a_s \in A \quad S_i(a_1, \dots, a_s) \iff T_i(\sigma(a_1), \dots, \sigma(a_s))$$

$$\forall a_1, \dots, a_u \in A \quad a \in G_j(a_1, \dots, a_u) \iff H_j(\sigma(a_1), \dots, \sigma(a_u)) = \sigma(a)$$

$$\sigma(a_k) = b_k$$

La definizione fondamentale della teoria dei modelli è la seguente: si dice che

una formula φ è soddisfatta (o vale) nel modello \mathcal{Q} per l'assegnamento f , o si

nota $\mathcal{Q} \models \varphi [f]$ ove $f: \mathcal{V} \rightarrow A$

se la formula φ risulta "vera" interpretando mediante f i simboli di \mathcal{L} , sostituendo

alle variabili: valori loro assegnati da f , e dando ai connettivi logici, ai quantificatori

e all' = i significati consueti.

Esercizio 5.1 Si dia una rigorosa definizione induttiva di $\mathcal{Q} \models \varphi [f]$

[Sugg.: Utilizzando (i) ed (ii) si estenda f ad $\bar{f}: \text{Termini} \rightarrow A$;indi, da (iii) ed (iv)
si dedica una definizione di $\mathcal{Q} \models \varphi [f]$ se φ è atomica; si usino infine
i significati intuitivi dei connettivi logici e dei quantificatori per definire $\mathcal{Q} \models \varphi [f]$
quando già si sa più definire $\mathcal{Q} \models \psi [f]$ e $\mathcal{Q} \models \chi [f]$]

E' immediato verificare che se due aequamenti f e g coincidono sulle variabili

libere di φ , allora $\mathcal{Q} \models \varphi[f] \iff \mathcal{Q} \models \varphi[g]$. Pertanto si puo', se le va-

riabili libere di φ sono $\{x_1, \dots, x_n\}$ e se $f(x_i) = a_i$ ($i=1, \dots, n$) si scriverà

$\varphi = \varphi(x_1, \dots, x_n)$ e $\mathcal{Q} \models \varphi[a_1, \dots, a_n]$ intendendo $\mathcal{Q} \models \varphi[f]$.

Si osservi che in particolare se φ è una sentenza $\mathcal{Q} \models \varphi$ vale o non vale

indipendentemente dall'aequamento prescelto, che potra pertanto essere omesso.

Se si ha un insieme Φ di formule $\mathcal{Q} \models \Phi[f]$ significherà $\mathcal{Q} \models \varphi[f]$

per ogni $\varphi \in \Phi$ (si osservi che se Φ è finito si può sempre ridursi ad una sola formula considerando la congiunzione degli elementi di Φ).

Se Σ è un insieme di sentenze, ogni struttura $\mathcal{Q} \models \Sigma$ si dice un modello di Σ . L'insieme di tutte le sentenze di L valide in un modello

\mathcal{Q} si chiama la teoria di \mathcal{Q} .

E' noto che vi sono semplici regole di deduzione che permettono, dato un insieme Σ di sentenze, di determinare altre sentenze come conseguenze di Σ .

Σ si dice coerente se esistono sentenze non deducibili da Σ (equiventemente se non si può dedurre da Σ una sentenza della forma $\varphi \wedge \neg \varphi$).

Il legame fra il concetto sintattico di deducibilità e la teoria dei modelli è dato dal seguente

Teorema di completezza: Un insieme di sentenze Σ è coerente se e solo se possiede un modello.

Non dimostreremo il teorema di completezza in quanto esula dai nostri scopi; ne deduciamo invece due utili corollari (notiamo $\Sigma \vdash \tau$ per τ si deduce da Σ)

Corollario 1: $\Sigma \vdash \tau \iff$ in ogni modello di Σ vale anche τ .

Corollario 2 (teorema di compattanza): Un insieme di sentenze Σ ha un modello se e solo se ogni suo sottoinsieme finito ne ha uno.

Corollario 3: Se τ vale in ogni modello di Σ vale anche in ogni modello di un opportuno sottoinsieme finito di Σ .

Osserviamo che si potrebbe utilizzare il corollario 1 per definire semanticamente la deducibilità: in tal caso il teorema di completezza diventerebbe banale, ma il teorema di compattanza non sarebbe più un corollario.

Esercizio 5.2: Si dimostri che se σ e τ sono sentenze $\sigma \vdash \tau \iff \phi \vdash \sigma \rightarrow \tau$.

Cioè non vale per formule φ, ψ con variabili libere, anche se non incognite.

Citiamo ancora per conoscenza l'importante teorema che permette di avere modelli di cardinalità limitata:

Teorema (di Löwenheim-Skolem): Se un insieme di sentenze Σ è coerente, allora ha un modello A t.c. $|A| \leq |\Sigma| + \aleph_0$.

In particolare, se L è numerabile, ogni insieme coerente di sentenze ammette un modello finito o numerabile.

L'aspetto paradosale di tale teorema (un modello numerabile della teoria degli insiemi deve verificare, ad es., il teorema di Cantor $2^{\aleph_0} > \aleph_0$) mette in luce l'importanza del concetto di assolutessa di una formula. Si pone allora

Definizione 5.1: Siano A, B modelli per L , $A \subseteq B$; sia φ una formula di L .

~~L'assolutessa di φ è definita come~~ - Diciamo allora

(i) φ è stabile per estensione da A a B se $A \models \varphi[f] \Rightarrow B \models \varphi[f]$

(ii) φ è stabile per restrizione da B a A se $B \models \varphi[f] \Rightarrow A \models \varphi[f]$

(iii) φ è assoluta fra A e B se $B \models \varphi[f] \Leftrightarrow A \models \varphi[f]$

per ogni anagnamento $f: V \rightarrow A \subseteq B$.

Un termine t è stabile o assoluto secondo che lo è la formula $x=t$, ove x è una variabile che non compare in t .

Lema 5.2 Sia $\varphi(y, x_1, \dots, x_n)$ una formula assoluta fra due modelli $Q \subseteq B$.

Se esiste una funzione di Skolem per φ in B tale che $\hat{f}(A^n) \subseteq A$, allora

anche $\exists y \varphi$ è assoluta fra Q e B .

Dimo: Per Lema 5.13 $\exists y \varphi$ è stabile per estensione; resta dunque da dimostrare che

$B \models \exists y \varphi [a_1, \dots, a_n] \Rightarrow Q \models \exists y \varphi [a_1, \dots, a_n] \quad \forall a_1, \dots, a_n \in A$. Ma questo è ovvio utilizzando la funz. di Skolem f e tenendo presente che $f(a_1, \dots, a_n) \in A$.

QED

Concludiamo con un'ultima nozione che avrà grosse applicazioni in seguito:

Definizione 5.3 Dati due modelli $Q \subseteq B$ si dice che $Q \prec B$ (Q è sottostruttura

elementare di B) se ogni formula è assoluta fra Q e B .

Un'immersione elementare $j: E \rightarrow B$ è un isomorfismo fra

E ed un sotto modello elementare di B .

Tenendo conto che ogni formula si può esprimere equivalentemente con l'uso del solo quantificatore esistenziale (ed anche, ma qui non occorre, coi soli connettivi \wedge e \vee), dai Lemmi 5.1 e 5.2

segue immediatamente:

Corollario 5.3.1: Se esiste un insieme F di funzioni di Skolem in $B \supseteq Q$, una per ogni formula

di L, e se A è chiuso per ogni elemento di F, allora $Q \prec B$.

Definizione 5.4 Dici si famiglia di Skolem per un modello \mathcal{A} una famiglia \mathcal{F} di funzioni di Skolem tale che per ogni formula φ esiste $f \in \mathcal{F}$ che è di Skolem per φ in \mathcal{A} .

Osservando che l'insieme delle formule di un linguaggio \mathcal{L} ha per cardinalità $\|\mathcal{L}\| = \max(H_0, |\mathcal{L}|)$, è immediato dimostrare il seguente

Lema 5.3 Ogni modello \mathcal{A} per il linguaggio \mathcal{L} possiede famiglie di Skolem \mathcal{F} tali che $|\mathcal{F}| \leq \|\mathcal{L}\|$

Mediante i lemmi precedenti dimostriremo allora il seguente teorema, da cui è facile dedurre il teorema di Löwenheim-Skolem in forma ancor più forte di quella a p. 65:

Teorema 5.1: Sia B un modello per \mathcal{L} e sia $C \subseteq B$ (universo di B). Allora esiste un sottodello elementare $\mathcal{A} \prec B$ t.c. $C \subseteq A \subseteq B$ e $|A| \leq |C| + \|\mathcal{L}\|$.

Dimo: Sia \mathcal{F} una fam. di Skolem per B , $|\mathcal{F}| \leq \|\mathcal{L}\|$. Poniamo $A_0 = C$, $A_{n+1} = A_n \cup \mathcal{F}(A_n)$ ove $\mathcal{F}(A_n) = \{x \in B \mid \exists f \in \mathcal{F}, x_1, \dots, x_m \in A_n \text{ t.c. } x = f(x_1, \dots, x_m)\}$.

Sia allora \mathcal{A} il sottodello di B avendo per universo $A = \bigcup_{n \in \omega} A_n$ e per relaz., funz., cost quelle indotte da B . E' ovvio che \mathcal{A} verifica le condizioni richieste e, per il Coroll. 5.3.1, \mathcal{A} risulta sottodello elementare di B (si osservi che in una famiglia di Skolem ci sono necessariamente tutte le costanti e tutte le funzioni di B).

QED

5.1 I risultati e le definizioni del paragrafo 5.0 valgono naturalmente nel caso (cui ci limitiamo d'ora in poi) in cui $\mathcal{L} = \{\in\}$ è il linguaggio della teoria degli insiemi col solo simbolo di relazione \in . In tal caso un modello per \mathcal{L} è una coppia $\mathfrak{A} = (A, E)$ ove A è un insieme (talvolta una classe) ed E una relazione binaria su A . Un modello \mathfrak{A} si dice standard se $E = \in \cap A \times A$; in tal caso spesso si indicherà il solo universo A , e si scriverà semplicemente $A \models \varphi [f]$ intendendo $(A, \in \cap A \times A) \models \varphi [f]$.

Nel caso del linguaggio \mathcal{L} è utile la classificazione delle formule dovuta a Lévy:

Definizione 5.5: Un quantificatore si dice ristretto nella formula φ se compare nel modo seguente: $\exists x(x \in y \wedge \psi)$ ovvero $\forall x(x \in y \rightarrow \psi)$

Come è usuale i quantificatori ristretti si scrivono in forma abbreviata: $\exists x \in y (\psi)$ ovvero $\forall x \in y (\psi)$.

Una formula si dice ristretta se ogni quantificatore che vi compare è ristretto.

Definizione 5.6 Gli insiemi di formule Σ_n e Π_n sono definiti induttivamente dalle seguenti predefinizioni:

(i) $\Sigma_0 = \Pi_0 = \Delta_0 = \{ \varphi \mid \varphi \text{ ristretta} \}$

(ii) $\varphi \in \Sigma_n \Rightarrow \cancel{\forall} \times \varphi \in \Pi_{n+1}$

(iii) $\varphi \in \Pi_n \Rightarrow \exists \times \varphi \in \Sigma_{n+1}$

Questa definizione è puramente sintattica; diventa interessante la sua generalizzazione
semantica ad una teoria $\overset{T}{\mathbb{M}}$ (insieme di sentenze), che nel nostro caso sarà usualmente ZF (oia la teoria con gli assiomi A.1,..,A8,A10) e raramente qualche sua estensione.

Definizione 5.6 Sia T una teoria. Gli insiemi di formule $\Pi_n^T, \Sigma_n^T, \Delta_n^T$ sono definiti nel modo seguente

(i) $\varphi \in \Pi_n^T$ (risp. Σ_n^T) se esiste $\psi \in \Pi_n$ (risp. Σ_n) tc. $T \vdash \varphi \leftrightarrow \psi$

(ii) $\Delta_n^T = \Sigma_n^T \cap \Pi_n^T$

Esercizio 5.3 Si dimostri che se T contiene ZF, allora valgono le seguenti affermazioni:

1. Se $m < n$, allora $\Sigma_m^T \cup \Pi_m^T \subseteq \Delta_n^T$

2. $\varphi \in \Sigma_n^T \Leftrightarrow \neg \varphi \in \Pi_n^T$; $\varphi \in \Pi_n^T \Leftrightarrow \neg \varphi \in \Sigma_n^T$

3. $\varphi, \psi \in \Sigma_n^T$ (risp. Π_n^T) $\Rightarrow \varphi \wedge \psi, \varphi \vee \psi \in \Sigma_n^T$ (risp. Π_n^T)

4. $\varphi \in \Sigma_n^T, \psi \in \Pi_n^T \Rightarrow \varphi \wedge \psi, \varphi \vee \psi \in \Delta_{n+1}^T$; $\varphi \rightarrow \psi \in \Pi_n^T$; $\psi \rightarrow \varphi \in \Sigma_n^T$

74

$$5. \varphi \in \Sigma_m^T \Rightarrow \forall x \varphi \in \Pi_{m+1}^T \text{ e (se } m > 0) \exists x \varphi \in \Sigma_m^T$$

$$6. \varphi \in \Pi_m^T \Rightarrow \exists x \varphi \in \Sigma_{m+1}^T \text{ e (se } m > 0) \forall x \varphi \in \Pi_m^T$$

$$\therefore \bigcup_{n \in \omega} \Sigma_n^T = \bigcup_{n \in \omega} \Pi_n^T = \bigcup_{n \in \omega} \Delta_n^T = \{\varphi \mid \varphi \text{ formula}\}$$

[N.B. Gli assiomi di rimpiazzamento, fondazione, infinito non sono mai utilizzati;
si cominci col dimostrare 5 e 6, notando che $\exists = \{x, y\} \in \Delta_0^T$]

L'importanza del considerare la quantificazione ritorta risulta dal seguente

Lemma 5.4: Sia T una teoria contenente ZF. Allora se $\varphi \in \Sigma_m^T$ (risp. $\varphi \in \Pi_m^T$)

anche $\forall x \exists y \varphi \in \exists x \forall y \varphi \in \Sigma_m^T$ (risp. Π_m^T).

Dimo: Il caso $\varphi \in \Pi_m^T$ segue uscendo la negazione da quello in cui $\varphi \in \Sigma_m^T$; d'altra parte è ovvio che $\varphi \in \Sigma_m^T \Rightarrow \exists x \forall y \varphi \in \Sigma_m^T$ (vedi Eserc. 5.3.5).

Resta dunque da vedere che $\forall x \exists y \varphi \in \Sigma_m^T$; ciò è ovvio se $m=0$; si procederà dunque per induzione supponendo la tesi per $m-1$.

Sia dunque $\varphi = \exists t \psi$, con $\psi \in \Pi_{m-1}^T$, e sia x una variabile che non compare in φ . Si consideri $\{t \mid \text{t ha raggi minimo fra quelli per cui vale } \psi(x, t)\} = I(x)$ (ovviamente $I(x) = \emptyset$ se non esiste tale accertabile t); $I(x)$ è un insieme però \subseteq in qualche V_x . Ponendo $Z = \bigcup_{t \in I(x)} I(x)$ si ha ovviamente in ogni teoria $T \models \text{ZF}$ (si avrà che qui si è usato anche l'assioma di fondazione e il rimpiazzamento):

$$T + \forall x \exists y [\exists t \psi(x, t) \leftrightarrow \exists t \in Z \psi(x, t)] \text{ e quindi}$$

$$T + \forall x \forall t \exists t \psi(x, t) \leftrightarrow \exists Z \forall x \exists t \in Z \psi(x, t)$$

Questa ultima formula è Σ_m^T per i poteri induttivi, in quanto $\psi(x, t) \in \Pi_{m-1}^T$.

Sposto ora di dirà brevemente che un termine definito, del tipo $t = \{x \mid \varphi(x)\}$, è Σ_u^T (risp. Π_u^T , Δ_u^T) se lo è la formula $y = t$ (ove y è una variabile che non compare in t). E' immediato allora, utilizzando per $\varphi(x)$ un'espressione alternativamente $\Sigma_u \in \text{TT}_u$, dimostrare

Coroll. 5.4 Se $\varphi(x) \in \Delta_u^T$, allora $\{x \mid \varphi(x)\} \in \text{TT}_u^T$ e

$$\{x \in a \mid \varphi(x)\} \in \Delta_u^T \quad (\text{perché } u \geq 1)$$

Il modo più potente di definire termini è però l'induzione trasfusa: in genere si definisce un termine t_α induttivamente perché si disponga di una formula $\psi(x, \alpha, b_1, \dots, b_n; y)$ di tipo funzionale, cioè tale che $\forall x, \alpha, b_1, \dots, b_n$ esista un sol y verificante ψ . In tal caso $y = t_\alpha \leftrightarrow \psi(t_\alpha / x, \alpha, b_1, \dots, b_n; y)$.

Per le definizioni per induzione vale il seguente

Lema 5.5 Sia t_α definito induttivamente dalla formula funzionale $\psi \in \Sigma_1^T$.

Allora $t_\alpha \in \Delta_\alpha^T$.

Dim: In effetti $y = t_\alpha \leftrightarrow \exists f (\underline{f \text{ ben fatta per } \psi}, \alpha \in \text{dom } f \wedge f(\alpha) = y)$
 $\qquad \qquad \qquad \leftrightarrow \forall f (\underline{f \text{ ben fatta per } \psi}, \alpha \in \text{dom } f \rightarrow f(\alpha) = y)$

Ora f ben fatta per ψ significa che f è una funzione, il dominio di f è un ordinale e $\forall \beta \in \text{dom } f$ si ha $\# = f(\beta) \leftrightarrow \psi(f/\#; \beta, b_1, \dots, b_n; \#)$. E' immediato constatare

che la definizione data di ben fatta coincide e formalizza il concetto di definizione per induzione, e che pertanto due funzioni ben fatte coincidono sugli argomenti comuni; da la tesi seguirà dal coroll. 5.4.1 a patto che "f ben fatta per ψ " sia Σ_1^T (vedi anche l'esercizio 5.3): e scrivendo esplicitamente la definizione in modo formale, si vede immediatamente che è composta di ψ (che è Σ_1^T) e di altre formule (di tipo Δ_0^T per l'es. sul doppio), pertanto Σ_1^T come folto.

QED

I risultati precedenti permettono, con un semplice ma assai tedioso lavoro di scrittura e riscrittura formale delle definizioni, di ottenere una catalogazione di quasi tutt'e quattro i morisoni invenibile introdotte; ~~ma anche~~ ^{classificano} le più utili nel seguenti

Esercizio 5.3. 1. Sono Δ_0^{ZF} le seguenti formule ed i seguenti termini:

$x \leq y$, \emptyset , $\{x, y\}$, (x, y) , $x \times y$, $x - y$, $x \cap y$,

x transitivo, α ordinale, α limite, $\forall x$, $x \cup \{x\}$, ω , n ,

x relazione, f funzione, f iniettiva, Dom f , Im f , $f(x)$, $\hat{f}(x)$, $f|_X$.

2. Sono Δ_1^{ZF} : $TC(x)$, $\rho(x)$, V_ω , ${}^\alpha A$,

r ben fondato su x , r buon ordinamento su x ,

. $\alpha + \beta$, $\alpha \beta$, α^β (come ordinali)

3. Sono Σ_1^{ZF} : $|x|=|y|$, $|x| \leq |y|$, x numerabile, $\text{cof } x = \text{cof } y$

4. Sono Π_1^{ZF} : μ cardinale, μ regolare, μ limite, μ inaccessibile,
 $\wp(x) \neq x$