

Теоремы по матану, семестр 4

17 июня 2018 г.

Содержание

| | | |
|-----|--|----|
| 1 | Характеризация измеримых функций с помощью ступенчатых (формулировка). Следствия | 6 |
| 2 | Измеримость монотонной функции | 7 |
| 3 | Теорема Лебега о сходимости почти везде и сходимости по мере | 8 |
| 4 | Теорема Рисса о сходимости по мере и сходимости почти везде | 9 |
| 5 | Простейшие свойства интеграла Лебега | 10 |
| 5.1 | Для определения (5), ступенчатые функции | 10 |
| 5.2 | Для окончательного определения | 11 |
| 6 | Счетная аддитивность интеграла (по множеству) | 13 |
| 7 | Теорема Леви | 15 |
| 8 | Линейность интеграла Лебега | 16 |
| 9 | Теорема об интегрировании положительных рядов | 17 |
| 10 | Теорема о произведении мер | 18 |

| | |
|---|-----------|
| 11 Абсолютная непрерывность интеграла | 19 |
| 11.1 Следствие | 20 |
| 12 Теорема Лебега о мажорированной сходимости для случая сходимости по мере. | 20 |
| 13 Теорема Лебега о мажорированной сходимости для случая сходимости почти везде. | 22 |
| 14 Теорема Фату. Следствия. | 23 |
| 14.1 Следствие 1 | 24 |
| 14.2 Следствие 2 | 24 |
| 15 Теорема о вычислении интеграла по взвешенному образу меры | 25 |
| 15.1 Лемма | 25 |
| 15.2 Следствие | 25 |
| 15.3 Теорема | 25 |
| 16 Критерий плотности | 26 |
| 17 Лемма о единственности плотности | 27 |
| 18 Лемма о множестве положительности | 28 |
| 19 Теорема Радона-Никодима | 29 |
| 20 Лемма об оценке мер образов кубов из окрестности точки дифференцируемости | 30 |
| 21 Лемма «Вариации на тему регулярности меры Лебега» | 31 |
| 22 Теорема о преобразовании меры при диффеоморфизме | 33 |
| 23 Теорема о гладкой замене переменной в интеграле Лебега | 34 |

| | |
|---|----|
| 24 Теорема (принцип Кавальери) | 34 |
| 25 Теорема Тонелли | 36 |
| 26 Формула для Бета-функции | 38 |
| 27 Объем шара в \mathbb{R}^m | 38 |
| 28 Теорема о вложении пространств L^p | 39 |
| 29 Теорема о сходимости в L_p и по мере | 39 |
| 30 Полнота L^p | 40 |
| 31 Лемма Урысона | 41 |
| 32 Плотность в L^p непрерывных финитных функций | 43 |
| 33 Теорема о непрерывности сдвига | 43 |
| 34 Теорема об интеграле с функцией распределения | 44 |
| 35 Теорема о свойствах сходимости в гильбертовом пространстве | 44 |
| 36 Теорема о коэффициентах разложения по ортогональной системе | 45 |
| 37 Теорема о свойствах частичных сумм ряда Фурье. Неравенство Бесселя | 46 |
| 38 Теорема Рисса – Фишера о сумме ряда Фурье. Равенство Парсеваля | 47 |
| 39 Теорема о характеристике базиса | 48 |
| 39.1 $1 \Rightarrow 2$ | 48 |
| 39.2 $2 \Rightarrow 3$ | 48 |
| 39.3 $3 \Rightarrow 4$ | 49 |

| | | |
|------|--|----|
| 39.4 | $4 \Rightarrow 1$ | 49 |
| 39.5 | $4 \Rightarrow 5$ | 49 |
| 39.6 | $5 \Rightarrow 4$ | 49 |
| 40 | Лемма о вычислении коэффициентов тригонометрического ряда | 49 |
| 41 | Теорема Римана–Лебега | 50 |
| 42 | Принцип локализации Римана | 51 |
| 43 | Признак Дини. Следствия | 52 |
| 44 | Корректность свертки | 53 |
| 45 | Свойства свертки функции из L^p с функцией из L^q | 54 |
| 46 | Формула Грина | 55 |
| 47 | Формула Стокса | 57 |
| 48 | Формула Гаусса–Остроградского | 58 |
| 49 | Соленоидальность бездивергентного векторного поля | 58 |
| 50 | Предельный переход под знаком интеграла при наличии равномерной сходимости или L_{loc} | 59 |
| 50.1 | При равномерной сходимости | 59 |
| 50.2 | При L_{loc} | 60 |
| 51 | Правило Лейбница дифференцирования интеграла по параметру | 61 |
| 52 | Теорема о свойствах аппроксимативной единицы | 61 |
| 53 | Теорема Фейера. | 63 |

| | | |
|------|--|----|
| 54 | Свойства преобразования Фурье: непрерывность, ограниченность, сдвиг. TODO | 63 |
| 55 | Преобразование Фурье свертки. | 63 |
| 56 | Преобразование Фурье и дифференцирование | 64 |
| 56.1 | Обозначения | 64 |
| 56.2 | Утверждение: при п.в. u : $f(u, t) \rightarrow 0$ ($t \rightarrow \infty$) | 65 |
| 56.3 | Доказательство основного факта теоремы: | 65 |
| 57 | Лемма об оценке интеграла ядра Дирихле | 65 |
| 58 | Теорема об интегрировании ряда Фурье | 66 |
| 59 | Лемма о сходимости сумм Фурье в смысле обобщенных функций | 67 |
| 60 | Следствие о преобразовании Фурье финитных функций | 68 |
| 61 | Лемма "о ядре Дирихле". | 69 |
| 62 | Теорема о равносходимости ряда Фурье и интеграла Фурье | 70 |
| 63 | Признак Дирихле—Жордана | 71 |
| 64 | Лемма к теореме о формуле обращения. | 71 |
| 65 | Формула обращения преобразования Фурье. | 72 |
| 66 | Свойства свертки. Deprecated | 73 |
| 67 | О локальной суммируемости. Deprecated | 73 |

1 Характеризация измеримых функций с помощью ступенчатых (формулировка). Следствия

(X, \mathbb{A}, μ) — пространство с мерой.

f — измеримая функция на X , $\forall x \ f(x) \geq 0$. Тогда \exists ступенчатые функции f_n , такие что:

1. $\forall x \ 0 \leq f_n(x) \leq f_{n+1}(x) \leq f(x)$.
2. $f_n(x)$ поточечно сходится к $f(x)$.

Следствие 1:

$f : X \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$ измеримая. Тогда \exists ступенчатая $f_n : \forall x : \lim f_n(x) = f(x)$ и $|f_n(x)| \leq |f(x)|$.

Доказательство:

1. Рассмотрим $f = f^+ - f^-$. $f^+ = \max(f, 0)$, $f^- = \max(-f, 0)$. Срезки измеримы: $E(f^+ < a) = E(f < a) \cap E(0 < a)$, при этом f и $g \equiv 0$ измеримы (f^- измерима аналогично).
2. Срезки измеримы и неотрицательны, тогда по теореме существуют ступенчатые функции $f_n^+ \rightarrow f^+$, $f_n^- \rightarrow f^-$. Тогда и $f_n^+ - f_n^-$ это ступенчатая функция, при этом по свойству пределов: $f_n^+ - f_n^- \rightarrow f^+ - f^- = f$. $|f_n| = |f_n^-| + |f_n^+|$, $|f| = |f^-| + |f^+|$ (так как одновременно только одна срезка может быть неотрицательно), поэтому $|f_n| \leq |f|$

Следствие 2:

f, g — измеримые функции. Тогда fg — измеримая функция. При этом считаем, что $0 \cdot \infty = 0$.

Доказательство:

1. Рассмотрим $f_n \rightarrow f : |f_n| \leq |f|$, $g_n \rightarrow g : |g_n| \leq |g|$ из первого следствия. Тогда $f_n g_n \rightarrow fg$ и fg измерима по теореме об измеримости пределов и супремумов (произведение ступенчатых функций — ступенчатая функция, значит, измеримая)

Следствие 3:

f, g — измеримые функции. Тогда $f + g$ — измеримая функция. При этом считаем, что $\forall x$ не может быть, что $f(x) = \pm\infty, g(x) = \mp\infty$

Доказательство:

Доказывается как следствие 2.

2 Измеримость монотонной функции

Пусть $E \subset \mathbb{R}^m$ — измеримое по Лебегу, $E' \subset E, \lambda_m(E \setminus E') = 0, f : E \rightarrow \mathbb{R}$. Пусть сужение $f : E' \rightarrow \mathbb{R}$ непрерывно. Тогда f измерима на E .

Доказательство:

1. $E(f < a) = E'(f < a) \cup e(f < a), e := E \setminus E', \lambda_m(e) = 0$.
2. $E'(f < a)$ открыто в E' , так как f непрерывна (прообраз открытого множества открыт). $E'(f < a) = E' \cap F$, где F открыто в \mathbb{R}^m (теорема об открытых множествах в пространстве и подпространстве). F измеримо, поскольку открытые множества измеримы. E' измеримо. Поэтому $E'(f < a)$ измеримо как пересечение измеримых.
3. $e(f < a)$ — подмножество e , а $\lambda_m(e) = 0$, поэтому $\lambda_m(e(f < a)) = 0 \Rightarrow e(f < a)$ измеримо
4. Следовательно $E(f < a)$ измеримо как объединение измеримых множеств, следовательно, f измерима на E .

Следствие:

$f : (a, b) \rightarrow \mathbb{R}$ монотонна. Тогда f измерима.

Доказательство:

Множество разрывов монотонной функции не более чем счётно, поэтому можно воспользоваться доказанной теоремой.

3 Теорема Лебега о сходимости почти везде и сходимости по мере

(X, \mathbb{A}, μ) - пространство с мерой, $\mu \cdot X < +\infty$

$f_n, f : X \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$ - п.в. конечны, измеримы

$f_n \rightarrow f$ (поточечно, п.в.)

Тогда $f_n \xrightarrow{\mu} f$

Доказательство:

1. подменим значения f_n и f на некотором множестве меры 0 так, чтобы сходимость $f_n \rightarrow f$ была всюду. (Так можно сделать. Действительно, $f_n \rightarrow f$ на $X \setminus e$, $\mu e = 0$

f_n - конечно на $X \setminus e_n$,

f - конечно на $X \setminus e_0$.

Тогда на $(X \setminus \bigcup_{n=0}^{+\infty} e_n)$ функции конечны и есть сходимость $f_n \rightarrow f$. По

свойствам меры $\mu \bigcup_{n=0}^{+\infty} e_n = 0$. Тогда определим на $\bigcup_{n=0}^{+\infty} e_n$ $f_n = f = 0$.

Это очевидно даст нам необходимую конечность и поточечную сходимость.)

2. (частный случай) $f_n \rightarrow f \equiv 0$. Тогда пусть $\forall x f_n(x)$ - монотонно (по n). $|f_n(x)|$ - убывает с ростом n и $X(|f_n| \geq \epsilon) \supset X(|f_{n+1}| \geq \epsilon)$. А также $\bigcap_{n=0}^{+\infty} X(|f_n| \geq \epsilon) = \emptyset$.

$$\begin{cases} \mu X < +\infty \\ \dots \supset E_n \supset E_{n+1} \supset \dots \end{cases}$$

$\Rightarrow \mu E_n \rightarrow \mu \cap E_n$ - Th о непрерывности меры сверху.

$\Rightarrow \mu X(|f_n| \geq \epsilon) \rightarrow \mu \emptyset = 0$

3. (общий случай) $f_n \rightarrow f$. Рассмотрим $\phi_n(x) := \sup_{k \geq n} |f_k(x) - f(x)|$. Заметим свойства ϕ :

$$\begin{cases} \phi_n(x) \rightarrow 0 \\ \phi_n \downarrow_n \end{cases}$$

$X(|f_n - f| \geq \epsilon) \subset X(\phi_n \geq \epsilon) \Rightarrow$ по монотонности меры имеем
 $\mu X(|f_n - f| \geq \epsilon) \leq \mu X(\phi_n \geq \epsilon) \xrightarrow{part.case} 0$, ч.т.д.

4 Теорема Рисса о сходимости по мере и сходимости почти везде

(X, \mathbb{A}, μ) - пространство с мерой

$f_n, f : X \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$ - п.в. конечны, измеримы

$f_n \xrightarrow{\mu} f$.

Тогда $\exists n_k \uparrow : f_{n_k} \rightarrow f$ п.в.

Доказательство: $\forall k \mu X(|f_n - f| \geq \frac{1}{k}) \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0$

Тогда $\exists n_k : \forall n \geq n_k : \mu X(|f_n - f| \geq \frac{1}{k}) < \frac{1}{2^k}$ (можно считать $n_1 < n_2 < \dots$)

Проверим $f_{n_k} \rightarrow f$ п.в. :

$$E_k := \bigcup_{j=k}^{+\infty} X(|f_{n_j} - f| \geq \frac{1}{j})$$

$$E_1 \supset E_2 \supset E_3 \supset \dots$$

$$E_0 := \bigcap_{k \in \mathbb{N}} E_k.$$

$\mu E_k \leq \sum_{j=k}^{+\infty} \mu X(|f_{n_j} - f| \geq \frac{1}{j}) \leq \sum_{j=k}^{+\infty} \frac{1}{2^j} = \frac{2}{2^k} = 2^{1-k}$ - конечно, убывает
 $\Rightarrow \mu E_k \rightarrow \mu E_0 \Rightarrow \mu E_0 = 0$ (т.к. $\mu E_k \rightarrow 0$).

Рассмотрим $x \notin E_0$, т.е. $\exists k : x \notin E_k$. Тогда $\forall j \geq k |f_{n_j}(x) - f(x)| < \frac{1}{j}$
при $n \geq n_j$, т.е. $f_{n_k} \rightarrow f$, ч.т.д.

Следствие: Если $f_n \Rightarrow f$ и $|f_n| \leq g$ п.в., то $|f| \leq g$ п.в.

Доказательство: Рассмотрим последовательность f_{n_k} где $f_{n_k} \rightarrow f$ п.в. и вдоль нее применим Th о двух городских.

$$\begin{cases} f_{n_k}(x) \rightarrow f(x) \quad \forall x \in X \setminus e_1 \\ |f_{n_k}(x)| \leq g(x) \quad \forall x \in X \setminus e_2 \end{cases}$$

$$\Rightarrow |f| \leq g \text{ на } (X \setminus e_1) \setminus e_2$$

5 Простейшие свойства интеграла Лебега

5.1 Для определения (5), ступенчатые функции

1. $\int_{\mathbb{X}} f$ не зависит от представления f как ступенчатой функции, то есть если f реализуется как $f = \sum_k (\lambda_k \cdot \chi_{E_k})$ и как $f = \sum_l (\alpha_l \cdot \chi_{G_l})$, то интегралы по этим функциям равны

Доказательство:

Выпишем общее разбиение для этих двух разбиений

Пусть $F_{ij} = E_i \cap G_j$

Тогда $f = \sum_k (\lambda_k \cdot \chi_{E_k}) = \sum_l (\alpha_l \cdot \chi_{G_l}) = \sum_{i,j} (\lambda_i (= \alpha_j) \cdot \chi_{F_{i,j}})$

$\int f = \sum_{i,j} (\lambda_i \cdot \mu F_{i,j}) = \sum_i (\lambda_i \cdot \sum_j (\mu F_{i,j})) = \sum_i (\lambda_i \cdot \mu E_i) = \int f$ для первого разбиения

Аналогично для второго разбиения получаем

$\int f = \sum_{i,j} (\alpha_j \cdot \mu F_{i,j}) = \sum_j (\alpha_j \cdot \sum_i (\mu F_{i,j})) = \sum_j (\alpha_j \cdot \mu G_j) = \int f$ для второго разбиения, что и требовалось доказать

2. f, g -измеримые ступенчатые функции, $f \leq g$, тогда $\int_{\mathbb{X}} f \leq \int_{\mathbb{X}} g$

Доказательство:

Пусть $f = \sum_k (\lambda_k \cdot \chi_{E_k})$, $g = \sum_l (\alpha_l \cdot \chi_{G_l})$

Аналогично доказательству предыдущей теоремы, строим общее ступенчатое разбиение

Пусть $F_{ij} = E_i \cap G_j$

Тогда $\int f = \sum_{i,j} (\lambda_i \cdot \mu F_{i,j}) \leq \sum_j (\alpha_j \cdot \mu G_j) = \int g$, что и требовалось доказать

5.2 Для окончательного определения

1. Монотонность $f \leq g \Rightarrow \int_{\mathbb{X}} f \leq \int_{\mathbb{X}} g$

Доказательство:

(a) $f, g \geq 0$, тогда доказательство тривиально (по свойствам супремума)

$$(b) \int_{\mathbb{X}} f = \int_{\mathbb{X}} f^+ - \int_{\mathbb{X}} f^-$$

$$\int_{\mathbb{X}} g = \int_{\mathbb{X}} g^+ - \int_{\mathbb{X}} g^-$$

Из того, что $\int_{\mathbb{X}} f^+ \leq \int_{\mathbb{X}} g^+$, а $\int_{\mathbb{X}} f^- \geq \int_{\mathbb{X}} g^-$ следует, что $\int_{\mathbb{X}} f \leq \int_{\mathbb{X}} g$

$$2. \int_{\mathbb{E}} 1 \cdot d\mu = \mu E$$

$$\int_{\mathbb{E}} 0 \cdot d\mu = 0$$

Очевидно из определения интеграла ступенчатой функции

3. $\mu E = 0$, f -измерима, тогда $\int_{\mathbb{E}} f = 0$, даже если $f = \infty$ на \mathbb{E}

Доказательство:

(a) f -ступенчатая \Rightarrow ограниченная

$$f = \sum_{k=1}^n (\lambda_k \cdot \chi_{E_k}), \text{ тогда } \int_{\mathbb{E}} f = \sum \lambda_k \cdot \mu(E \cap E_k)$$

Но $\mu(E \cap E_k) = 0$ (так как $\mu E = 0$), тогда $\int_{\mathbb{E}} f = 0$

(b) f - измеримая, $f \geq 0$.

$$\int_{\mathbb{E}} f = \sup \left(\int_{\mathbb{E}} g \right), \text{ где } 0 \leq g \leq f, g - \text{ ступенчатая}$$

$$\text{Тогда } \int_{\mathbb{E}} f = \sup(0) = 0$$

(c) f - произвольная измеримая

$$\text{Тогда } \int_{\mathbb{E}} f = \int_{\mathbb{E}} f^+ - \int_{\mathbb{E}} f^- = 0 - 0 = 0$$

$$4. (a) \int_{\mathbb{E}} -f = - \int_{\mathbb{E}} f$$

$$(b) \forall c \in \mathbb{R} : \int_{\mathbb{E}} (c \cdot f) = c \cdot \int_{\mathbb{E}} f$$

Доказательство:

$$(a) (-f)^+ = f^-$$

$$(-f)^- = f^+$$

$$\text{Тогда } \int_{\mathbb{E}} -f = \int_{\mathbb{E}} (-f)^+ - \int_{\mathbb{E}} (-f)^- = \int_{\mathbb{E}} f^- - \int_{\mathbb{E}} f^+ = - \int_{\mathbb{E}} f$$

(b) Пусть $c > 0$. Если $c < 0$, то по предыдущему случаю можем рассматривать для $-c < 0$. Если $c = 0$, то по пункту 2 $\int_{\mathbb{E}} (0 \cdot f) =$

$$\int_{\mathbb{E}} 0 = 0 = 0 \cdot \int_{\mathbb{E}} f$$

i. Пусть $f \geq 0$

$$\int_{\mathbb{E}} (c \cdot f) = \sup \left(\int_{\mathbb{E}} g \right), \text{ где } 0 \leq g \leq c \cdot f, g - \text{ ступенчатая}$$

$$\text{Пусть } g = c \cdot \tilde{g}, \text{ тогда } \int_{\mathbb{E}} (c \cdot f) = \sup \left(\int_{\mathbb{E}} (c \cdot \tilde{g}) \right), \text{ где } 0 \leq c \cdot \tilde{g} \leq c \cdot f,$$

\tilde{g} - ступенчатая

$$\text{Тогда } \int_{\mathbb{E}} (c \cdot f) = \sup \left(\int_{\mathbb{E}} (c \cdot \tilde{g}) \right) = \sup \left(c \cdot \int_{\mathbb{E}} \tilde{g} \right) = c \cdot \sup \left(\int_{\mathbb{E}} \tilde{g} \right) = c \cdot \int_{\mathbb{E}} f$$

ii. Если f - произвольная:

$$\begin{aligned} \int_{\mathbb{E}} (c \cdot f) &= \int_{\mathbb{E}} (c \cdot f)^+ - \int_{\mathbb{E}} (c \cdot f)^- = \int_{\mathbb{E}} c \cdot f^+ - \int_{\mathbb{E}} c \cdot f^- = c \cdot \int_{\mathbb{E}} f^+ - \\ c \cdot \int_{\mathbb{E}} f^- &= c \cdot \left(\int_{\mathbb{E}} f^+ - \int_{\mathbb{E}} f^- \right) = c \cdot \int_{\mathbb{E}} f \end{aligned}$$

5. Если существует $\int_{\mathbb{E}} f d\mu$, то $\left| \int_{\mathbb{E}} f \right| \leq \int_{\mathbb{E}} |f|$

Доказательство:

$$-|f| \leq f \leq |f|$$

$$\int_{\mathbb{E}} -|f| \leq \int_{\mathbb{E}} f \leq \int_{\mathbb{E}} |f|$$

$$- \int_{\mathbb{E}} |f| \leq \int_{\mathbb{E}} f \leq \int_{\mathbb{E}} |f|$$

$$\text{Тогда } \left| \int_{\mathbb{E}} f \right| \leq \int_{\mathbb{E}} |f|$$

6. f - измеримая на \mathbb{E} , $\mu\mathbb{E} < \infty$

$$a \leq f \leq b, \text{ тогда } a \cdot \mu E \leq \int_{\mathbb{E}} f \leq b \cdot \mu E$$

Доказательство:

$$a \leq f \leq b \Rightarrow \int_{\mathbb{E}} a \leq \int_{\mathbb{E}} f \leq \int_{\mathbb{E}} b$$

$$a \cdot \int_{\mathbb{E}} 1 \leq \int_{\mathbb{E}} f \leq b \cdot \int_{\mathbb{E}} 1$$

$$a \cdot \mu\mathbb{E} \leq \int_{\mathbb{E}} f \leq b \cdot \mu\mathbb{E}$$

Следствие:

Если f - Измеримая и ограниченная на \mathbb{E} , $\mu\mathbb{E} < \infty$, тогда f - суммируемая на \mathbb{E}

7. f - суммируемая на $\mathbb{E} \Rightarrow f$ почти везде конечная на \mathbb{E} (то есть $f \in \alpha^0(\mathbb{E})$)

Доказательство:

(a) Пусть $f \geq 0$

Пусть $f = +\infty$ на A и пусть $\mu A > 0$

Тогда $\forall n \in \mathbb{N} : f \geq n \cdot \chi_A$

$$\text{Тогда } \forall n \in \mathbb{N} : \int_{\mathbb{E}} f \geq n \cdot \int_{\mathbb{E}} \chi_A = n \cdot \mu A \Rightarrow \int_{\mathbb{E}} f = +\infty$$

(b) f любого знака

Распишем $f = f^+ - f^-$, по предыдущему пункту f^+, f^- конечны почти везде $\Rightarrow f$ тоже конечно почти везде

6 Счетная аддитивность интеграла (по множеству)

(X, \mathbb{A}, μ) — пространство с мерой, $A = \bigsqcup_{i=1}^{\infty} A_i$ — измеримы. $f : X \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$ — изм., $f \geq 0$

Тогда: $\int_A f = \sum_{i=1}^{\infty} \int_{A_i} f$

Доказательство:

1. Для начала докажем это для ступенчатых функций. Пусть $f = \sum_k (\lambda_k \cdot \chi_{E_k})$

$$\int_A f d\mu = \sum_k (\lambda_k \cdot \mu(E_k \cap A)) = \sum_k (\lambda_k \cdot (\sum_i \mu(E_k \cap A_i))) = \sum_i (\sum_k (\lambda_k \cdot \mu(E_k \cap A_i))) = \sum_i \left(\int_{A_i} f \right)$$

2. Докажем, что $\int_A f \leq \sum_i \int_{A_i} f$

(a) Рассмотрим $0 \leq g \leq f$ — ступенчатая. $\int_A g = \sum_i \int_{A_i} g \leq \sum_i \int_{A_i} f$

(b) Переходя к *sup* получаем желаемое

3. Теперь докажем, что $\int_A f \geq \sum_i \int_{A_i} f$

(a) $A = A_1 \sqcup A_2$

i. Рассмотрим g_1, g_2 — ступенчатые такие, что $0 \leq g_i \leq f \cdot \chi_{A_i}$

ii. Рассмотрим их общее разбиение E_k : $g_i = \sum_k (\lambda_k^i \cdot \chi_{E_k})$

iii. $g_1 + g_2$ — ступенчатая и $0 \leq g_1 + g_2 \leq f \cdot \chi_A$

iv. $\int_{A_1} g_1 + \int_{A_2} g_2 \stackrel{lemma}{=} \int_A (g_1 + g_2) \stackrel{iii}{\leq} \int_A f$

v. Поочерёдно переходя к *sup* по g_1 и g_2 получаем: $\int_{A_1} f + \int_{A_2} f \leq$

$$\int_A f$$

(b) $\forall n \in \mathbb{N}$, что $A = \bigsqcup_{i=1}^n A_i$ будем последовательно отщеплять последнее множество по (a)

$$(c) A = \bigsqcup_{i=1}^{\infty} A_i$$

i. Фиксируем $n \in \mathbb{N}$

$$ii. A = \left(\bigsqcup_{i=1}^n A_i \right) \sqcup B, \text{ где } B = \bigsqcup_{i=n+1}^{\infty} A_i$$

$$iii. \int_A f = \sum_{i=1}^n \int_{A_i} f + \int_B f \geq \sum_{i=1}^n \int_{A_i} f \text{ (равенство, поскольку мы рассматриваем } A \text{ как конечное объединение } A_1, \dots, A_n \text{ и } B).$$

iv. Переходим к \lim по n

$$\text{Следствие 1: } 0 \leq f \leq g - \text{измеримы и } A \subset B - \text{измеримы} \Rightarrow \int_A f \leq \int_B g$$

$$\int_B g \geq \int_B f = \int_A f + \int_{B \setminus A} f \geq \int_A f$$

$$\text{Следствие 2: } f - \text{суммируема на } A \Rightarrow \int_A f = \sum_i \int_{A_i} f$$

Достаточно рассмотреть срезки f^+ и f^-

$$\text{Следствие 3: } f \geq 0 - \text{изм. } \delta : \mathbb{A} \rightarrow \overline{\mathbb{R}} (A \mapsto \int_A f d\mu) \Rightarrow \delta - \text{мера}$$

7 Теорема Леви

$(X, \mathbb{A}, \mu), f_n \geq 0$ - изм.

$f_1(x) \leq \dots \leq f_n(x) \leq f_{n+1}(x) \leq \dots$ при почти всех x

$f(x) = \lim_{n \rightarrow \infty} f_n(x)$ при почти всех x (считаем, что при остальных $x : f \equiv 0$)

$$\text{Тогда: } \lim_{n \rightarrow \infty} \int_X f_n(x) d\mu = \int_X f(x) d\mu$$

Доказательство:

$$N.B. \int_X f_n \leq \int_X f_{n+1} \Rightarrow \exists \lim$$

f - измерима как предел последовательности измеримых функций

1. \leq

Очевидно: $f_n \leq f$ при п.в $x \Rightarrow \int_X f_n \leq \int_X f$. Делаем предельный переход по n .

2. \geq

(a) Логичная редукция: хочется доказать, что $\lim_{n \rightarrow \infty} \int_X f_n(x) \geq \int_X g$, где $0 \leq g \leq f$, g ступенчатая.

(b) Наглая редукция: докажем, что $\forall c \in (0, 1) : \lim \int_X f_n(x) \geq c \cdot \int_X g$

i. $E_n = \{x \mid f_n(x) \geq c \cdot g\}$. Очевидно $E_1 \subset \dots \subset E_n \subset E_{n+1} \subset \dots$

ii. $\bigcup_{n=1}^{\infty} E_n = X$ т.к. $c < 1$

iii. $\int_X f_n \geq \int_{E_n} f_n \geq \int_{E_n} c \cdot g$ (по определению E_n)
 $\Rightarrow \lim \int_X f_n \geq c \cdot \lim \int_{E_n} g = c \cdot \int_X g$

iv. Последний знак равно обусловлен тем, что интеграл неотрицательной и измеримой функции по множеству - мера (см. следствие 3 предыдущей теоремы), и мы используем непрерывность меры снизу

v. Устремляем c к 1.

8 Линейность интеграла Лебега

$f, g \geq 0$, измеримые

Тогда $\int_{\mathbb{E}} (f + g) = \int_{\mathbb{E}} f + \int_{\mathbb{E}} g$

Доказательство:

1. Пусть f, g - ступенчатые, тогда у них имеется общее разбиение

$$f = \sum_k (\lambda_k \cdot \chi_{E_k})$$

$$g = \sum_k (\alpha_k \cdot \chi_{E_k})$$

$$\int_{\mathbb{E}} (f + g) = \sum_k (\lambda_k + \alpha_k) \cdot \mu E_k = \sum_k \lambda_k \cdot \mu E_k + \sum_k \alpha_k \cdot \mu E_k = \int_{\mathbb{E}} f + \int_{\mathbb{E}} g,$$

что и требовалось доказать

2. $f, g \geq 0$, измеримые

Тогда $\exists h_n : 0 \leq h_n \leq h_{n+1} \leq f$, h_n ступенчатые

$\exists \widetilde{h_n} : 0 \leq \widetilde{h_n} \leq \widetilde{h_{n+1}} \leq g$, $\widetilde{h_n}$ ступенчатые

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} h_n = f$$

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \widetilde{h_n} = g$$

$$\int_{\mathbb{E}} (h_n + \widetilde{h_n}) = \int_{\mathbb{E}} h_n + \int_{\mathbb{E}} \widetilde{h_n}$$

$$\int_{\mathbb{E}} (h_n + \widetilde{h_n}) \rightarrow \int_{\mathbb{E}} (f + g)$$

$$\int_{\mathbb{E}} h_n \rightarrow \int_{\mathbb{E}} f$$

$$\int_{\mathbb{E}} \widetilde{h_n} \rightarrow \int_{\mathbb{E}} g$$

Тогда $\int_{\mathbb{E}} (f + g) = \int_{\mathbb{E}} f + \int_{\mathbb{E}} g$, что и требовалось доказать

3. Если f, g - любые измеримые, распишем обе через срезки и докажем для них

9 Теорема об интегрировании положительных рядов

$u_n(x) \geq 0$ почти всюду на \mathbb{E} , тогда $\int_{\mathbb{E}} (\sum_{n=1}^{+\infty} u_n(x)) d\mu(x) = \sum_{n=1}^{+\infty} \int_{\mathbb{E}} u_n(x) d\mu(x)$

Доказательство:

$$S_N(x) = \sum_{n=1}^N u_n(x); S(x) = \sum_{n=1}^{+\infty} u_n(x)$$

$$1. S_N - \text{возрастает к } S \text{ при почти всех } x \xrightarrow{\text{Т. Леви}} \int_{\mathbb{E}} S_N \xrightarrow{N \rightarrow +\infty} \int_{\mathbb{E}} S = \int_{\mathbb{E}} \sum_{n=1}^{+\infty} u_n(x)$$

$$2. \text{ С другой стороны } \int_{\mathbb{E}} S_N = \int_{\mathbb{E}} \sum_{n=1}^N u_n = \sum_{n=1}^N \int_{\mathbb{E}} u_n(x) d\mu \xrightarrow{N \rightarrow +\infty} \sum_{n=1}^{+\infty} \int_{\mathbb{E}} u_n(x) d\mu$$

3. Найденные пределы совпадают в силу единственности предела последовательности, что и требовалось доказать.

10 Теорема о произведении мер

$\langle X, \mathbb{A}, \mu \rangle, \langle Y, \mathbb{B}, \nu \rangle$ - пространства с мерой

$$\mathbb{A} \times \mathbb{B} = \{A \times B \subset X \times Y : A \in \mathbb{A}, B \in \mathbb{B}\}$$

$$m_0(A \times B) = \mu A \cdot \nu B$$

Тогда:

1. m_0 - мера на полукольце $\mathbb{A} \times \mathbb{B}$
2. μ, ν - σ -конечны $\Rightarrow m_0$ - σ -конечна

Доказательство:

1. Неотрицательность m_0 очевидна. Необходимо доказать счетную аддитивность

Пусть $P = \bigsqcup_{i=1}^{\infty} P_k$, где $P \in \mathbb{A} \times \mathbb{B}$

$$P = A \times B; \quad P_k = A_k \times B_k$$

Заметим, что:

- $\chi_P(x, y) = \sum \chi_{P_k}(x, y)$, в силу дизъюнктности P_k ((x, y) входит максимум в одно множество из всех P_k)

- $\chi_{A \times B}(x, y) = \chi_A(x) \cdot \chi_B(y)$, так как $(x, y) \in A \times B \Leftrightarrow x \in A$ и $y \in B$

Воспользовавшись вышесказанным получим:

$$\chi_P(x, y) = \chi_{A \times B}(x, y) = \chi_A(x) \cdot \chi_B(y)$$

$$\chi_P(x, y) = \sum \chi_{P_k}(x, y) = \sum \chi_{A_k \times B_k}(x, y) = \sum \chi_{A_k}(x) \cdot \chi_{B_k}(y)$$

Имеем следующее равенство:

$$\chi_A(x) \cdot \chi_B(y) = \sum \chi_{A_k}(x) \cdot \chi_{B_k}(y)$$

Проинтегрируем его по мере μ по x , затем по мере ν по y , получим:

$\mu A \cdot \nu B = \sum \mu A_k \cdot \nu B_k$, то есть $m_0(P) = \sum m_0(P_k)$, что и требовалось доказать.

$$2. \mu, \nu - \sigma\text{-конечны} \Rightarrow X = \bigcup_{k=1}^{\infty} A_k, \text{ где } \mu A_k < +\infty; Y = \bigcup_{k=1}^{\infty} B_k, \text{ где } \nu B_k < +\infty$$

$$X \times Y = \bigcup_{i,j} (A_i \times B_j)$$

$$m_0(A_i \times B_j) = \mu A_i \cdot \nu B_j < +\infty, \text{ так как } \mu A_i < +\infty \text{ и } \nu B_j < +\infty$$

все $(A_i \times B_j) \in \mathbb{A} \times \mathbb{B}$ по определению

Что и требовалось доказать.

11 Абсолютная непрерывность интеграла

$\langle X, \mathbb{A}, \mu \rangle$ - пространство с мерой

$f : X \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$ - суммируема

Тогда $\forall \epsilon > 0 \exists \delta > 0 : \forall E - \text{измеримое } \mu E < \delta \mid \int_E f d\mu \mid < \epsilon$

Доказательство:

$$X_n := X(|f| \geq n)$$

$$X_n \supset X_{n+1} \supset \dots$$

$\mu(\cap X_n) = 0$, т.к. f — суммируема и потому почти везде конечна.

1. Мера : $(A \mapsto \int |f|)$ также равна 0 на $\cap X_n$. По непрерывности сверху:

$$\forall \epsilon > 0 \exists n_\epsilon \int_{X_{n_\epsilon}}^A |f| < \epsilon/2$$

2. Зафиксируем ϵ в доказываемом утверждении, возьмем $\delta := \frac{\epsilon/2}{n_\epsilon}$

$$3. \left| \int_E f d\mu \right| \leq \int_E |f| = \int_{E \cap X_{n_\epsilon}} |f| + \int_{E \cap X_{n_\epsilon}^c} |f| \stackrel{*}{\leq} \int_{X_{n_\epsilon}} |f| + n_\epsilon \cdot \mu(E \cap X_{n_\epsilon}^c) \stackrel{**}{<} \epsilon/2 + n_\epsilon \cdot \mu E < \epsilon/2 + n_\epsilon \cdot \frac{\epsilon/2}{n_\epsilon} < \epsilon$$

* - В первом слагаемом увеличили множество, во втором посмотрели на определение X_n , взяли дополнение, воспользовались 6-м простейшим свойством интеграла

** - Воспользовались непрерывностью сверху

11.1 Следствие

f — суммируема

e_n — измеримые множества

Тогда если $\mu e_n \rightarrow 0$, то $\int_{e_n} f \rightarrow 0$

12 Теорема Лебега о мажорированной сходимости для случая сходимости по мере.

$\langle X, \mathbb{A}, \mu \rangle$ — пространство с мерой,

f_n, f — измеримы,

$f_n \xrightarrow{\mu} f$ (сходится по мере),

$\exists g : X \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$ такая, что:

- $\forall n$, для «почти всех» x $|f_n(x)| \leq g(x)$ (g называется мажорантой)
- g — суммируемая

Тогда:

- f_n, f – суммируемы
- $\int_X |f_n - f| d\mu \rightarrow 0$
- $\int_X f_n \rightarrow \int_X f$ («уж тем более»)

Доказательство:

1. f_n – суммируема, так как существует мажоранта g :

$$(a) |f_n| \leq g, \text{ поэтому } \int_X |f_n| \leq \int_X g.$$

$$(b) g \text{ суммируема и положительна} \Rightarrow \int_X g < +\infty \Rightarrow \int_X |f_n| < +\infty \Rightarrow f_n \text{ суммируема.}$$

2. f – суммируема по теореме Рисса ($f_{n_k} \rightarrow f$ почти везде, $|f_{n_k}| \leq g$, тогда $|f| \leq g$ почти везде)

3. «уж тем более»:

$$\left| \int_{\mathbb{X}} f_n - \int_{\mathbb{X}} f \right| \leq \int_{\mathbb{X}} |f_n - f|$$

Допустим, что $\int_X |f_n - f| d\mu \rightarrow 0$ уже доказано.

Тогда «уж тем более» очевидно.

4. Докажем основное утверждение:

Разберем два случая:

$$(a) \mu X < \infty \text{ Фиксируем } \epsilon \geq 0 \quad X_n := X(|f_n - f| \geq \epsilon)$$

$$\mu X_n \rightarrow 0 \text{ (так как } f_n \Rightarrow f)$$

$$\int_X |f_n - f| = \int_{X_n} |f_n - f| + \int_{X_n^c} |f_n - f| \leq \int_{X_n} 2g + \int_{X_n^c} \epsilon < \epsilon + \epsilon \mu X$$

(прим. $\int_{X_n} 2g \rightarrow 0$ по след. к т. об абс. сходимости)

(b) $\mu X = \infty$

Докажем «Антиабсолютную непрерывность» для g :

$$\forall \epsilon \exists A \subset X : \mu A - \text{конечно}, \int_{X \setminus A} g < \epsilon$$

доказательство:

$$\int_X g = \sup \left\{ \int_X g_k \mid 0 \leq g_k \leq g \right\} \quad (g_k - \text{ступен.})$$

$$\exists g_n : \int_X g - \int_X g_n < \epsilon$$

$$A := \text{supp } g_n \quad (\text{supp } f := \{x \mid f(x) \neq 0\})$$

$$A = \bigcup_{k \mid \alpha_k \neq 0} E_k \quad (\text{где } g_n = \sum_{\text{конечная}} \alpha_k \chi_{E_k})$$

$$\int_X g_n = \sum \alpha_k \mu E_k < +\infty \quad (\mu A - \text{конеч.})$$

$$\int_{X \setminus A} g = \int_{X \setminus A} (g - g_n) \leq \int_X (g - g_n) < \epsilon$$

Теперь докажем основное утверждение:

$$\int_X |f_n - f| = \int_A |f_n - f| + \int_{X \setminus A} |f_n - f| \leq \int_A |f_n - f| + 2\epsilon < 3\epsilon$$

$$\left(\int_A |f_n - f| \rightarrow 0 \text{ по п. (a)} \right)$$

13 Теорема Лебега о мажорированной сходимости для случая сходимости почти везде.

$\langle X, \mathbb{A}, \mu \rangle$ – пространство с мерой,

f_n, f – измеримы,

$f_n \rightarrow f$ **почти везде**,

$\exists g : X \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$ такая, что:

- $\forall n$, для «почти всех» x $|f_n(x)| \leq g(x)$ (g называется мажорантой)
- g – суммируемая

Тогда:

- f_n, f — суммируемы
- $\int_X |f_n - f| d\mu \rightarrow 0$
- $\int_X f_n \rightarrow \int_X f$ («уж тем более»)

Доказательство:

1. Суммируемость и «уж тем более» см. пред. теорему.

2. Докажем основное утверждение:

$$h_n(x) := \sup(|f_n - f|, |f_{n+1} - f|, \dots)$$

Заметим, что при фикс. x выпол. $0 \leq h_n \leq 2g$ почти везде

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} h_n = \overline{\lim}_{n \rightarrow +\infty} |f_n - f| = 0 \text{ почти везде}$$

$2g - h_n \uparrow, 2g - h_n \rightarrow 2g$ почти везде

$$\int_X (2g - h_n) d\mu \rightarrow \int_X 2g \text{ (по т. Леви)}$$

$$\int_X 2g - \int_X h \rightarrow \int_X 2g, \text{ значит, } \int_X h_n \rightarrow 0$$

$$\int_X |f_n - f| \leq \int_X h_n \rightarrow 0$$

14 Теорема Фату. Следствия.

$\langle X, \mathbb{A}, \mu \rangle$ — пространство с мерой

f_n, f — измеримы,

$$f_n \geq 0$$

$f_n \rightarrow f$ «почти везде»

$$\exists C > 0 \forall n \int_X f_n d\mu \leq C$$

Тогда: $\int_X f \leq C$

Доказательство:

$$g_n := \inf(f_n, f_{n+1}, \dots) \quad (g_n \leq g_{n+1} \leq \dots)$$

$$\lim g_n = \underline{\lim}(f_n) \stackrel{\text{почти везде}}{=} \lim f_n = f \quad (g_n \rightarrow f \text{ почти везде})$$

$$\int_X g_n \leq \int_X f_n \leq C$$

$$\int_X f = \text{no m. Леви} = \lim \int_X g_n \leq C$$

14.1 Следствие 1

$f_n, f \geq 0$ – измер.

$$f_n \xrightarrow{\mu} f$$

$$\exists C \forall n \int_X f_n \leq C$$

Тогда:

$$\bullet \int_X f \leq C$$

Доказательство:

$$\exists f_{n_k} \rightarrow f \text{ почти везде}$$

14.2 Следствие 2

$f_n \geq 0$ – измер.

Тогда:

$$\bullet \int_X \underline{\lim} f_n \leq \underline{\lim} \int_X f_n$$

Доказательство:

$$g_n := \inf(f_n, f_{n+1}, \dots) \quad (g_n \leq g_{n+1} \leq \dots)$$

$$g := \lim g_n = \underline{\lim} f_n$$

$\int_X g_n \leq \int_X f_n$ по монотонности интеграла. Перейдём к нижнему пределу по n :

$$\underline{\lim} \int_X g_n \leq \underline{\lim} \int_X f_n$$

$$\int_X g \stackrel{\text{т. Леви}}{=} \lim \int_X g_n = \underline{\lim} \int_X g_n$$

15 Теорема о вычислении интеграла по взвешенному образу меры

15.1 Лемма

Пусть у нас есть $\langle X, \mathbb{A}, \mu \rangle$ и $\langle Y, \mathbb{B}, \nu \rangle$ и $\Phi : X \rightarrow Y$

Пусть $\Phi^{-1}(\mathbb{B}) \subset \mathbb{A}$

Пусть для $E \in \mathbb{B}$ $\nu(E) := \mu(\Phi^{-1}(E))$

Тогда:

ν — мера на (Y, \mathbb{B}) , $\nu(E) = \int_{\Phi^{-1}(E)} 1 \cdot d\mu$

Доказательство:

Докажем по определению меры:

$$\nu(\bigsqcup E_i) = \mu(\Phi^{-1}(\bigsqcup E_i)) = \mu(\bigsqcup \Phi^{-1}(E_i)) = \sum \mu(\Phi^{-1}(E_i)) = \sum \nu(E_i)$$

15.2 Следствие

Из этого следует, что если f — измеримая функция в Y (относительно ν), то $f \circ \Phi$ измерима относительно μ .

15.3 Теорема

Есть пространства $\langle X, \mathbb{A}, \mu \rangle$ и $\langle Y, \mathbb{B}, \nu \rangle$.

$\Phi : X \rightarrow Y$ $w \geq 0$ — измеримая, ν — взвешенный образ μ (w — плотность)

Тогда:

Для $\forall f \geq 0$ — измерима на Y , $f \circ \Phi$ — измерима (относительно μ)

$$\int_Y f d\nu = \int_X f(\Phi(x)) * w(x) d\mu(x)$$

Замечание: То же верно, если f суммируема.

Доказательство:

- $f \circ \Phi$ — измерима (из леммы)

- Возьмем $f = \chi_E, E \in \mathbb{B}$
 $(f \circ \Phi)(x) = \chi_{\Phi^{-1}(E)}$ — определение взвешенного образа меры
 $\nu(E) = \int_{\Phi^{-1}(E)} \omega d\mu$ — доказали первый пункт
- — f — ступенчатая $\Rightarrow f = \sum \alpha_k * \chi_{E_k}$

$$-\int_Y \sum \alpha_k * \chi_{E_k} d\nu = \sum_Y \int \alpha_k \chi_{E_k} d\nu \stackrel{\text{первый случай}}{=} \sum \alpha_k \int_X \chi_{E_k}(\Phi(x)) * \omega(x) dx = \int_X \sum \alpha_k \chi_{E_k}(\Phi(x)) * \omega(x) d\mu(x) = \int f \circ \Phi * \omega d\mu$$
- Если f — произвольная неотрицательная, то будем строить возрастающую последовательность ступенчатых, поточечно сходящихся к f . Тогда $\int_Y f_n d\nu = \int_X f_n(\Phi(x)) * \omega(x) d\mu(x)$. По теореме Леви делаем переход под знаком интеграла и всё доказываем.

16 Критерий плотности

Есть пространство $\langle X, \mathbb{A}, \mu \rangle$

ν — еще одна мера.

$\omega \geq 0$ — измерима на X .

Тогда:

ω — плотность ν относительно $\mu \iff$ Для любого $A \in \mathbb{A} : \mu A \cdot \inf_A(\omega) \leq \nu(A) \leq \mu A \cdot \sup_A(\omega)$

Доказательство:

- \Rightarrow : очевидно из стандартного свойства интеграла
- \Leftarrow

Докажем, что $\nu A = \int_A \omega \cdot d\mu$

Пусть $\omega = 0$ на A . Тогда $0 \cdot \mu A \leq \nu A \leq 0 \cdot \mu A \Rightarrow \nu A = 0$

$$\int_A \omega = \int_A 0 = 0$$

Пусть $\omega > 0$ на A (иначе выделим ту часть, где 0, для неё верно, докажем для остального). Зафиксируем произвольное $q \in (0; 1)$

Рассмотрим множества $A_j = \{x \in A : q^j \leq \omega(x) \leq q^{j+1}\}$

Из двусторонней оценки следует, что $q^j \cdot \mu A_j \leq \nu A_j \leq q^{j-1} \cdot \mu A_j$

Интегрируя по μ неравенство в определении A_j , получаем

$$q^j \cdot \mu A_j \leq \int_{A_j} w d\mu \leq q^{j-1} \cdot \mu A_j$$

Суммируя по j , получаем

$$q \cdot \int_A w d\mu \leq \sum_j q^j \nu A_j \leq \nu A \leq \frac{1}{q} \sum_j q^j \nu A_j \leq \frac{1}{q} \int_A w d\mu$$

Отсюда $q \cdot \int_A w d\mu \leq \nu A \leq \frac{1}{q} \int_A w d\mu$ для любого $q \in (0; 1)$. Переходим к пределу при $q \rightarrow 1$, получаем что нужно

17 Лемма о единственности плотности

$f, g \in L(x)$.

Пусть $\forall A$ — измеримо: $\int_A f = \int_A g$.

Тогда:

$f = g$ почти везде

Следствие:

Плотность ν относительно μ определена однозначно с точностью до μ -почти везде.

Доказательство:

- Вместо двух функций давайте рассмотрим одну $h = f - g$ и $\forall \int_A h = 0$. Пусть $A_+ = X(h \geq 0)$ и $A_- = X(h < 0)$
- $\int_{A_+} |h| = \int_{A_+} h = 0$
 $\int_{A_-} |h| = - \int_{A_-} h = 0$
- $X = A_+ \sqcup A_-$. Тогда $\int_X |h| = \int_{A_+} |h| + \int_{A_-} |h| = 0 \Rightarrow h = 0$ почти везде.

Почему? Ну потому что $\forall \epsilon > 0 : h > 0$ на X_ϵ меры 0 (иначе интеграл не 0)

То есть $|h| > \frac{1}{k}$ на X_k меры 0. Используем непрерывность сверху ($X_1 \subset X_2 \subset \dots$), поэтому $|h| > 0$ на X_0 меры 0, поэтому $h = 0$ пв

18 Лемма о множестве положительности

Пусть есть пространство $\langle X, \mathbb{A} \rangle$ и ϕ — заряд.

Тогда:

$\forall A \in \mathbb{A} \exists B \subset A : \phi(B) \geq \phi(A)$ и B — множество положительности

Доказательство:

- Если $\phi(A) \leq 0$, возьмём $B = \emptyset$. Далее $\phi(A) > 0$.
- E — множество ϵ -положительности (М ϵ П), если $\forall C \subset E, C$ измеримо: $\phi(C) \geq -\epsilon$
- **Утверждение:** $\forall \epsilon > 0$ A содержит М ϵ П C , такое что $\phi(C) \geq \phi(A)$.
 1. Если A — М ϵ П, то $C = A$
 2. Пусть A — не М ϵ П. Тогда существует $C_1 \subset A : \phi(C_1) < -\epsilon$.
Пусть $A_1 = A \setminus C_1$. $\phi(A_1) > \phi(A)$
 3. Если A_1 — М ϵ П, то это и есть искомое C . Иначе продолжим строить так A_2, A_3, \dots и C_2, \dots
 4. Процесс конечен, так как все C_i дизъюнкты, $\phi(C_i) < -\epsilon$, но $\phi(\bigsqcup C_i)$ конечно по определению заряда.
- Построим B : C_1 — множество 1-положительности в A . C_2 — множество $\frac{1}{2}$ -положительности в C_1 , и т. д. Тогда $B = \bigcap C_i$ — М ϵ П для любого ϵ , значит, это МП.
- $\phi(B) = \lim_{i \rightarrow \infty} \phi(C_i) \geq \phi(A)$ Это какая-то пародия на непрерывность меры, только для зарядов?

19 Теорема Радона-Никодима

Пусть есть пространство (X, \mathbb{A}, μ) .

ν — мера на \mathbb{A} .

Обе меры конечные и $\nu \prec \mu$ (абсолютная непрерывность меры: если $\mu E = 0$, то $\nu E = 0$).

Тогда:

$\exists! f : X \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$ (с точностью до почти везде), которая является плотностью ν относительно μ и при этом f суммируема по μ .

Доказательство:

• единственность — из леммы

• строим кандидата на роль f . $P = \{p(x) | p \geq 0, \text{ изм., } \forall E \in \mathbb{A} : \int_E p \cdot d\mu \leq \nu(E)\}$

1. $P \neq \emptyset$ и $0 \in P$

2. $p_1, p_2 \in P \Rightarrow h = \max(p_1, p_2) \in P$

$$\forall E \int_E h d\mu = \int_{E(p_1 \geq p_2)} h d\mu + \int_{E(p_1 < p_2)} h d\mu = \int_{E(p_1 \geq p_2)} p_1 + \int_{E(p_1 < p_2)} p_2 \leq \nu(E(p_1 \geq p_2)) + \nu(E(p_1 < p_2)) = \nu E$$

По индукции $\max(p_1 \dots p_n) \in P$

3. $I = \sup_{p \in P} \int_X p d\mu$

\exists последовательность $f_1 \leq f_2 \leq \dots \in P : \int_X f_n d\mu \rightarrow I$ докажем, что она существует

4. Рассмотрим $p_1, p_2, \dots : \int_X p_n \rightarrow I$ (потому что супремум), а также

$$f_n = \max(p_1 \dots p_n) \in P$$

5. $f := \lim f_n$. Тогда $\int_E f d\mu \stackrel{\text{т. Леви}}{=} \lim_E \int f_n d\mu \leq \nu E$, а следовательно

$$\int_X f = \lim_X \int_X f_n = I \leq \nu(X) \text{ Почему вообще } \int_X f_n d\mu \rightarrow I?$$

6. Отлично, проверим, что f — плотность ν относительно μ .

- (a) Предположим, что это не так: $\exists E_0 : \nu E_0 > \int_{E_0} f d\mu$
- (b) $\mu E_0 > 0$ (иначе интеграл равно нулю и мера ν равна нулю из абсолютной непрерывности)
- (c) Возьмем $a > 0 : \nu E_0 - \int_{E_0} f d\mu > a \cdot \mu E_0$
- (d) Рассмотрим заряд $\phi(E) = \nu E - \int_E f d\mu - a \cdot \mu E$ (это законно, потому что меры конечные)
- (e) $\phi(E_0) > 0$ (пункт **с**). Возьмем МП $B \subset E_0 : \phi(B) \geq \phi(E_0) > 0$. Тогда $\nu(B) = \phi(B) + \int_B f \cdot d\mu + a \cdot \mu B \geq \phi(B) > 0$
- (f) Проверим, что $f + a \cdot \chi_B \in P$. По определению: $\int_E (f + a \cdot \chi_B) d\mu =$

$$\int_{E \setminus B} f \cdot d\mu + \int_{E \cap B} f \cdot d\mu + a \cdot \mu(B \cap E) = \int_{E \setminus B} f + \nu(E \cap B) - \phi(E \cap B) \stackrel{f \in P}{\leq}$$

$$\nu(E \setminus B) + \nu(E \cap B) - \phi(E \cap B) = \nu E - \phi(E \cap B) \stackrel{\phi \geq 0}{\leq} \nu E$$
- (g) $\int_X f + a \cdot \chi_B = I + a \cdot \mu B > I$, что противоречит определению I .

20 Лемма об оценке мер образов кубов из окрестности точки дифференцируемости

$$\Phi : O \subset \mathbb{R}^m \rightarrow \mathbb{R}^m$$

$$a \in O, \Phi \in C^1(O)$$

$$\text{Возьмём } c > |\det \Phi'(a)| \neq 0$$

тогда $\exists \delta > 0 : \forall$ кубической ячейки $Q, Q \subset B(a, \delta), a \in Q$ выполняется $\lambda \Phi(Q) < c \cdot \lambda Q$

Доказательство

$\Phi(Q)$ измеримо, так как образ измеримого множества при гладком отображении измерим

$$L := \Phi'(a), L \text{ обратимо, так как } |\det L| \neq 0.$$

$$\Phi(x) = \Phi(a) + L(x - a) + o(x - a)$$

$$a + L^{-1}(\Phi(x) - \Phi(a)) = x + o(x - a)$$

Можем писать о малое, так как растяжение произошло не более чем в $|\det L^{-1}|$ раз, а $|\det L| \neq 0$

Пусть $\Psi(x) := a + L^{-1}(\Phi(x) - \Phi(a))$

$\forall \epsilon > 0 \exists B(a, \delta)$, такой, что при $x \in B(a, \delta)$ $|\Psi(x) - x| < \frac{\epsilon}{\sqrt{m}}|x - a|$ (так

как $\Psi(x)$ это почти x , только плюс $o(x - a)$)

$a \in Q \subset B(a, \delta)$, где Q — куб со стороной h

$x \in Q$, тогда $|a - x| < \sqrt{m} \cdot h$ (так как диагональ m -мерного куба со стороной h равна $\sqrt{m} \cdot h$)

Тогда $|\Psi(x) - x| < \epsilon h$

При $x, y \in Q, i \in \{1 \dots m\}$

$|\Psi(x)_i - \Psi(y)_i| \leq |\Psi(x)_i - x_i| + |\Psi(y)_i - y_i| + |x_i - y_i| \leq |\Psi(x) - x| + |\Psi(y) - y| + h < (1 + 2\epsilon)h$

$\Psi(Q) \subset$ кубу со стороной $(1 + 2\epsilon)h$

$\lambda(\Psi(Q)) < (1 + 2\epsilon)^m \lambda Q$

Φ выражается через Ψ через сдвиги и линейные преобразования. Тогда

$\lambda(\Phi(Q)) = |\det L| \cdot \lambda \Psi(Q) \leq |\det L| \cdot (1 + 2\epsilon)^m \cdot \lambda Q$

Возьмём ϵ так, чтобы $|\det L| \cdot (1 + 2\epsilon)^m$ было меньше c . Тогда при таком ϵ

$\lambda(\Phi(Q)) < c \cdot \lambda Q$

21 Лемма «Вариации на тему регулярности меры Лебега»

$f : O \subset \mathbb{R}^m \rightarrow \mathbb{R}$ — непрерывна.

$A \subset O$, A — измеримо.

$A \subset Q$ (кубическая ячейка) $\subset \overline{Q} \subset O$, то есть граница A не лежит на границе O .

Тогда

$$\inf_{A \subset G \subset O, G \text{ — open set}} (\lambda G \cdot \sup_G(f)) = \lambda A \cdot \sup_A f$$

Доказательство

Докажем, что левая часть \geq и \leq правой

\geq очевидно, так как правая часть - нижняя граница для всего, встречающегося под \inf

Докажем \leq

1. $\lambda A = 0$. Тогда правая часть $= 0$.

$$A \subset \overline{Q} \Rightarrow \sup_A f < +\infty$$

$$\overline{Q} - \text{компакт, } \alpha := \text{dist}(\overline{Q}, \partial O) > 0$$

Для множества $G : A \subset G \subset \frac{\alpha}{2}$ -окрестности ячейки Q

Назовём Q_1 кубическую ячейку, которая больше Q и у которой каждая сторона отстоит на $\frac{\alpha}{2\sqrt{m}}$ от соответствующей стороны Q .

$$A \subset G \subset \text{Int}(Q_1)$$

$$\sup_G f \leq \sup_{\overline{Q_1}} f < +\infty$$

При этом λG может быть выбрана сколь угодно близко к $\lambda A = 0$ по регулярности меры Лебега.

2. $\lambda A > 0, \sup_A f < c$

Возьмём c_1 :

$$\sup_A f < c_1 < c$$

Выберем ϵ так чтобы

$$\epsilon \cdot c_1 < \lambda A \cdot (c - c_1) \quad (*)$$

G_ϵ - такое множество, что $A \subset G_\epsilon, G_\epsilon$ -открытое, $\lambda(G_\epsilon \setminus A) < \epsilon$

$G_1 := f^{-1}((-\infty; c_1)) \cap G_\epsilon$ - открытое

$$\lambda(G_1 \setminus A) < \epsilon$$

$$\lambda G_1 \cdot \sup_{G_1} f \leq (\lambda A + \epsilon) \cdot c_1 < \lambda A \cdot c \text{ (из } (*))$$

(так как $G \subset f^{-1}((-\infty; c_1))$, то есть f на G_1 не больше c_1)

$$\inf(\lambda G \cdot \sup_G f) < \lambda A \cdot c$$

Переходя к \inf по c , получаем что требовалось

22 Теорема о преобразовании меры при диффеоморфизме

$\Phi : O \subset \mathbb{R}^m \rightarrow \mathbb{R}^m$ - Диффеоморфизм, $\forall A \in \mathbb{M}^m, A \subset O$

$$\lambda(\Phi(A)) = \int_A |\det \Phi'(x)| d\lambda(x)$$

Доказательство:

Пусть $\nu A = \lambda(\Phi(A))$, проверим, что $|\det \Phi'(x)|$ - плотность ν относительно λ .

Обозначим $J(x) = |\det \Phi'(x)|$

Проверим $\forall A : \inf_{x \in A} J(x) \cdot \lambda A \leq \nu A \leq \sup_{x \in A} J(x) \cdot \lambda A$

Достаточно проверить только правую, так как левая эквивалентна $\lambda A \leq (\inf_{x \in A} J(x))^{-1} \nu A$, а $(\inf_{x \in A} J(x))^{-1} = \sup_{x \in A} (J(x))^{-1} = \sup_{y \in A'} J_{\Phi^{-1}}(y)$ (где $A' = \Phi(A)$, $A = \Phi^{-1}(A')$)

Тогда $\lambda(\Phi^{-1}(A')) \leq \sup_{y \in A'} J_{\Phi^{-1}}(y) \cdot \lambda A'$ эквивалентно правому неравенству, но для Φ^{-1}

Докажем правую часть

1. A - кубическая ячейка, $A \subset \bar{A} \subset O$

Пусть это неверно, тогда $\exists Q : \sup_{x \in Q} J(x) \cdot \lambda Q < \nu Q$. Возьмём $c : \sup_{x \in Q} J(x) < c$, тогда $c \cdot \lambda Q < \nu Q$. Разобьём Q на 2^m кубических ячеек, сторона каждой из которых в 2 раза меньше стороны исходной, тогда $\exists Q_1 : c \cdot \lambda Q_1 < \nu Q_1$. Аналогично делим Q_1 , по индукции строим вложенную последовательность таких ячеек. $\forall n : c \cdot \lambda Q_n < \nu Q_n (*)$

Рассмотрим $a = \bigcap Q_n$, при этом $J(a) = |\det \Phi'(a)| < c$. Тогда по лемме $\exists B(a, \delta) : \text{при } Q_n \subset B(a, \delta) : \lambda \Phi(Q_n) < c \cdot \lambda Q_n$ - противоречие с $(*)$.

2. A - открытое множество. Тогда $A = \bigsqcup A_i$. (кубические ячейки). Способ разбиения был в прошлом семестре.

$$\text{Тогда } \nu A = \sum \nu A_i \leq \sum \sup_{A_i} J \cdot \lambda A_i \leq \sum \sup_A J \cdot \lambda A_i = \sup_A J \cdot \sum \lambda A_i = \sup_A J \cdot \lambda A$$

3. A - произвольное измеримое.

$\nu A \leq \nu G$ ($A \subset G, G$ - открытое), тогда $\nu A \leq \sup_G J \cdot \lambda G \Rightarrow \nu A \leq \inf_{A \subset G - \text{openset}} (\sup_G J \cdot \lambda G) \Rightarrow \nu A \leq \sup_A J \cdot \lambda A$ (из леммы)

23 Теорема о гладкой замене переменной в интеграле Лебега

$\Phi : O \subset \mathbb{R}^m \rightarrow \mathbb{R}^m$ - диффеоморфизм

$O' = \Phi(O)$ — открытое

f задана на $O', f \geq 0$, измерима по Лебегу, тогда

$$\int_{O'} f(y) \cdot d\lambda(y) = \int_O f(\Phi(x)) \cdot |\det \Phi'(x)| \cdot d\lambda(x)$$

Доказательство:

Изи.

$\nu(A) = \lambda\Phi(A)$, ν имеет плотность $J\Phi$ относительно λ .

Применить теорему об интеграле по взвешенному образу меры.

24 Теорема (принцип Кавальери)

(X, α, μ) и (Y, β, ν) — пространства с мерами, причем μ, ν — σ -конечные и полные

$m = \mu \times \nu, C \in \alpha \otimes \beta$, тогда:

1. При п.в. x C_x измеримо (ν -измеримо), т.е. $C_x \in \beta$
2. Функция $x \rightarrow \nu C_x$ — измеримая (в широком смысле) на X

NB: ϕ — измерима в широком смысле, если она задана при п.в. x , и $\exists f : X \rightarrow \mathbb{R}'$ — измеримая и $\phi = f$ п.в. При этом $\int_X \phi = \int_X f$ (по опр.)

$$3. mC = \int_X \nu(C_x) \cdot d\mu(x)$$

Доказательство: Рассмотрим D — совокупность все множеств C , для которых утверждение теоремы верно.

$\rho = \alpha \times \beta$ — полукольцо измеримых «прямоугольников».

1. $\rho \subset D$

$$C = A \times B. \text{ то есть } \forall x \ C_x = \begin{cases} \emptyset, x \notin A; \\ B, x \in A \end{cases}$$

$x \rightarrow \nu(C_x)$, функция $\nu(B) \cdot \chi_A(x)$ — изм.

$$\int_X \nu(C_x) d\mu = \nu B \int_X \chi_A(x) d\mu(x) = \nu B \cdot \mu A = mC$$

2. $E_i \in D$, E_i дизъюнкты $\Rightarrow E := \bigsqcup E_i \in D$

при п.в. x $(E_i)_x$ — измеримы

при п.в. x все $(E_i)_x$ — измеримы, $E_x = \bigsqcup (E_i)_x$ — измеримо.

$\nu E_x = \sum \nu(E_i)_x$ ($\nu(E_i)_x$ — изм. как функция от x) \Rightarrow функция

$x \rightarrow \nu E_x$ — измерима

$$\int_X \nu E_x d\mu(x) = \sum_i \int \nu(E_i)_x d\mu(x) = \sum_i mE_i = mE$$

3. $E_i \in D$, $E_1 \supset E_2 \supset \dots$; $mE_i < +\infty$. Тогда $E := \bigcap E_i \in D$

$$\int_X \nu(E_i)_x d\mu = mE_i < +\infty (*)$$

функция $x \rightarrow \nu(E_i)_x$ — суммируема \Rightarrow п.в. конечна.

при всех x $(E_i)_x \downarrow E_x$, т.е. $(E_1)_x \supset (E_2)_x \supset \dots$ и $\bigcap (E_i)_x = E_x$

при п.в. x $\nu(E_i)_x$ — конечны (для таких x).

Тогда E_x — измерима и $\lim \nu(E_i)_x = \nu E_x$ по непр-ти меры ν сверху.

(Th. Лебега) $|\nu(E_i)_x| \leq \nu(E_1)_x$ — сумм. \Rightarrow функция $x \rightarrow \nu E_x$ — изм.

$\int_X \nu E_x d\mu = \lim \int_X \nu(E_i)_x d\mu = \lim mE_i = mE$ (непр. сверху меры m).

Этот предельный переход корректен как раз по теореме Лебега

($f_n \rightarrow f$ п.в. $g : |f_n| \leq g$ — сумм. Тогда $\int f_n \rightarrow \int f$).

NB: мы доказали про пересечения и про объединения (пусть пересечения убывающие, а объединения — дизъюнкты, но это лечится).

Поэтому $\bigcap_j (\bigcup_i A_{i,j}) \in D$, если $A_{i,j} \in \rho$ ($\rho \subset D$).

Я точно не уверен, но вроде, дальше написан бред

4. $mE = 0 \Rightarrow E \in D$

$\exists H \in D$, H имеет вид $\bigcap (\bigcup A_{i,j})$, где все $A_{i,j} \in \rho$

$E \subset H$, $mH = 0$ из п.5 т. о продолжении **ЧТО?! поясните плз**

$$0 = mH = \int_X \nu H_x d\mu(x) \Rightarrow \nu H_x = 0 \text{ (= 0 при п.в. } x).$$

$$E_x \subset H_x \Rightarrow E_x - \nu\text{-изм. (из полноты } \nu) \text{ и } \nu E_x = 0 \text{ п.в. } x$$

$$\int_X \nu E_x d\mu = 0 = mE$$

5. **Неизмерима, но мера меньше ∞ ? ШТА?** C — неизм, $mC < +\infty$.
Тогда $C \in D$.

$$C = H \setminus e, \text{ где } me = 0, H - \text{вида } \cap(\cup A_{i,j}).$$

$$C_x = H_x \setminus e_x - \text{изм. при п.в. } x$$

$$\nu e_x = 0 \text{ п.в. } x \text{ (проверено в п.4)}$$

$$\nu C_x = \nu H_x = \nu e_x - \text{изм. п.в. } x$$

$$\int_X \nu C_x = \int_X \nu H_x - \int_X \nu e_x = \int_X \nu H_x = mH = mC.$$

6. **Что тут вообще написано? Что такое $\subset \cap(X_k \times Y_n)$** C — m -изм.
произвольное

$$X = \sqcup X_k, Y = \sqcup Y_n (\mu X_k - \text{кон, } \nu Y_n - \text{кон}).$$

$$C = \sqcup_{k,n} (\subset \cap(X_k \times Y_n)) \in D \text{ (по п.2) (т.к. } \subset \cap(X_k \times Y_n) \in D \text{ по п.5)}$$

25 Теорема Тонелли

$\langle X, \alpha, \mu \rangle, \langle Y, \beta, \nu \rangle$ - пространства с мерой

μ, ν - σ -конечны, полные

$$m = \mu \times \nu$$

$$f : X \times Y \rightarrow \overline{R}, f \geq 0, f - \text{измерима относительно } m$$

Тогда:

1. при почти всех $x \in X$ f_x - измерима на Y ,

$$\text{где } f_x : Y \rightarrow \overline{R}, f_x(y) = f(x, y)$$

(симметричное утверждение верно для y)

2. Функция $x \mapsto \phi(x) = \int_Y f_x d\nu = \int_Y f(x, y) d\nu(y)$ - измерима* на X

(симметричное утверждение верно для y)

$$3. \int_{X \times Y} f(x, y) dm = \int_X \phi(x) d\mu = \int_X \left(\int_Y f(x, y) d\nu(y) \right) d\mu(x) = \int_Y \left(\int_X f(x, y) d\mu(x) \right) d\nu(y)$$

Доказательство:

Докажем в 3 пункта, постепенно ослабляя ограничения на функцию f

1. Пусть $C \subset \mathbb{X} \times \mathbb{Y}$ - измеримо относительно m , $f = \chi_C$

(a) $f_x(y) = \chi_{C_x}(y)$, где C_x - сечение по x

C_x - измеримо при *почти всех* x , так как это одномерное сечение, таким образом f_x - измеримо, при *почти всех* x .

(b) $\phi(x) = \int_{\mathbb{Y}} f_x d\nu = \nu C_x$ - по принципу Кавальери это измеримая* функция.

$$(c) \int_{\mathbb{X}} \phi(x) d\mu = \int_{\mathbb{X}} \nu C_x d\mu \stackrel{\text{Кавальери}}{=} m C \stackrel{\text{опр. инт}}{=} \int_{\mathbb{X} \times \mathbb{Y}} \chi_C dm = \int_{\mathbb{X} \times \mathbb{Y}} f(x, y) dm$$

2. Пусть f - ступенчатая, $f \geq 0$, $f = \sum_{\text{кон}} a_k \chi_{C_k}$

(a) $f_x = \sum a_k \chi_{(C_k)_x}$ - измерима при почти всех x

(b) $\phi(x) = \sum a_k \nu(C_k)_x$ - измерима* как конечная сумма измеримых

$$(c) \int_{\mathbb{X}} \phi(x) d\mu = \int_{\mathbb{X}} \sum_{\text{кон}} a_k \nu(C_k)_x d\mu = \sum_{\text{кон}} \int_{\mathbb{X}} a_k \nu(C_k)_x d\mu = \sum a_k m C_k = \int_{\mathbb{X} \times \mathbb{Y}} f dm$$

3. Пусть f - измеримая, $f \geq 0$

$f = \lim_{n \rightarrow +\infty} g_n$, где $g_n \geq 0$ - ступенчатая, g_n - монотонно возрастает к f (из Теоремы об аппроксимации измеримой функции ступенчатыми)

(a) $f_x = \lim_{n \rightarrow +\infty} (g_n)_x \Rightarrow f_x$ - измерима при *почти всех* x .

$$(b) \phi(x) = \int_{\mathbb{Y}} f_x d\nu \stackrel{\text{т. Леви}}{=} \lim_{\mathbb{Y}} \int_{\mathbb{Y}} (g_n)_x d\nu$$

$\phi_n(x) := \int_{\mathbb{Y}} (g_n)_x d\nu$ - измерима по пункту 1

$0 \leq (g_n)_x$ - возрастает, тогда $\phi(x)$ - измерима, $\phi_n(x) \leq \phi_{n+1}(x) \leq \dots$ и $\phi_n(x) \rightarrow \phi(x)$

$$(c) \int_{\mathbb{X}} \phi(x) d\mu \stackrel{\text{т. Леви}}{=} \lim_{n \rightarrow +\infty} \int_{\mathbb{X}} \phi_n(x) d\mu \stackrel{\text{п.2}}{=} \lim_{n \rightarrow +\infty} \int_{\mathbb{X} \times \mathbb{Y}} g_n dm \stackrel{\text{т. Леви}}{=} \int_{\mathbb{X} \times \mathbb{Y}} f dm$$

26 Формула для Бета-функции

$B(s, t) = \int_0^1 x^{s-1}(1-x)^{t-1}$, где s и $t > 0$ - Бета-функция

$\Gamma(s) = \int_0^{+\infty} x^{s-1}e^{-x}dx$, где $s > 0$, тогда $B(s, t) = \frac{\Gamma(s)\Gamma(t)}{\Gamma(s+t)}$

Доказательство:

$$\begin{aligned} \Gamma(s)\Gamma(t) &= \int_0^{+\infty} x^{s-1}e^{-x} \left(\int_0^{+\infty} y^{t-1}e^{-y}dy \right) dx = \left[\begin{array}{c} y \rightarrow u \\ y = u - x \end{array} \right] = \int_0^{+\infty} x^{s-1} \left(\int_x^{+\infty} (u-x)^{t-1}e^{-u}du \right) dx = \\ &= \int_{\substack{x \geq 0 \\ u \geq x}} \dots = \text{меняем порядок интегрирования} \\ &= \int_0^{+\infty} du \int_0^u dx (x^{s-1}(u-x)^{t-1}e^{-u}) = \left[\begin{array}{c} x \rightarrow v \\ x = uv \end{array} \right] = \int_0^{+\infty} e^{-u} \left(\int_0^1 u^{s-1}v^{s-t}u^{t-1}(1-v)^{t-1}udv \right) du = \\ &= \int_0^{+\infty} u^{s+t-1}e^{-u} \left(\int_0^1 v^{s-1}(1-v)^{t-1}dv \right) du = B(s, t)\Gamma(s+t), \text{ чтд.} \end{aligned}$$

27 Объем шара в \mathbb{R}^m

$B(0, R) \subset \mathbb{R}^m$

$$\begin{aligned} \lambda_m(B(0, R)) &= \int_{B(0, R)} 1d\lambda_m = \int \mathcal{J} = \\ &= \int_0^R dr \int_0^\pi d\phi_1 \dots \int_0^\pi d\phi_{m-2} \int_0^{2\pi} d\phi_{m-1} \cdot r^{m-1}(\sin \phi_1)^{m-2} \dots (\sin \phi_{m-2}) \Rightarrow \\ &\int_0^\pi (\sin \phi_k)^{m-2-(k+1)} = B\left(\frac{m-k}{2}; \frac{1}{2}\right) = \frac{\Gamma(\frac{m-k}{2})\Gamma(\frac{1}{2})}{\Gamma(\frac{m-k}{2}+\frac{1}{2})} \text{почему так? надо бы попо-} \\ &\text{дробней расписать} \\ &\rightarrow = \frac{R^m}{m} \frac{\Gamma(\frac{m-1}{2})\Gamma(\frac{1}{2})}{\Gamma(\frac{m}{2})} \frac{\Gamma(\frac{m-2}{2})\Gamma(\frac{1}{2})}{\Gamma(\frac{m-1}{2})} \dots \frac{\Gamma(1)\Gamma(\frac{1}{2})}{\Gamma(\frac{3}{2})} 2\pi = \\ &= \frac{\pi R^m}{\frac{m}{2}} \frac{\Gamma(\frac{1}{2})^{m-2}}{\Gamma(\frac{m}{2})} = \frac{\pi^{\frac{m}{2}}}{\Gamma(\frac{m}{2}+1)} R^m \end{aligned}$$

28 Теорема о вложении пространств L^p

$$\mu E < +\infty, 1 \leq s < r \leq +\infty$$

Тогда:

$$1. L_r(E, \mu) \subset L_s(E, \mu)$$

$$2. \forall f \text{ — измеримая} : \|f\|_s \leq \mu E^{1/s-1/r} \|f\|_r$$

Доказательство:

- $2 \Rightarrow 1$ (Это очевидно: достаточно рассмотреть неравенство из пункта 2. Из него следует, что $\|f\|_s \leq \text{const} \cdot \|f\|_r$. см. опред. L_p)

- Рассмотрим два случая:

$$1. r = +\infty \text{ (очев.)}$$

$$\|f\|_s = \left(\int |f|^s \cdot 1 \right)^{1/s} \leq ((\text{esssup}|f|)^s \int 1 d\mu)^{1/s} = \|f\|_\infty \cdot \mu E^{1/s}$$

(последнее по определению esssup)

$$2. r < +\infty$$

$$(\|f\|_s)^s = \int |f|^s \cdot 1 d\mu \leq \left(\int |f|^r \right)^{\frac{s}{r}} \cdot \left(\int 1^{\frac{r}{r-s}} \right)^{\frac{r-s}{r}} = (\|f\|_r)^s \cdot \mu E^{1-\frac{s}{r}}$$

(существенный шаг: применить неравенство Гельдера)

29 Теорема о сходимости в L_p и по мере

$$1 \leq p < +\infty$$

$$f_n \in L_p(\mathbb{X}, \mu)$$

$$1. \bullet f \in L_p$$

- $f_n \rightarrow f$ в L_p

Тогда: $f_n \xrightarrow{\mu} f$ (по мере)

2. • $f_n \xrightarrow{\mu} f$ (либо если $f_n \rightarrow f$ почти везде)
 • $|f_n| \leq g$ почти везде при всех n ; $g \in L_p$

Тогда: $f_n \rightarrow f$ в L_p

Доказательство:

1.

$$X_n(\epsilon) := X(|f_n - f| \geq \epsilon)$$

$$\begin{aligned} \mu X_n(\epsilon) &\stackrel{\text{т.к. } \frac{|f_n-f|}{\epsilon} \geq 1}{\leq} \int_{X_n} \left(\frac{|f_n - f|}{\epsilon}\right)^p = \frac{1}{\epsilon^p} \int_{X_n} |f_n - f|^p \leq \frac{1}{\epsilon^p} \int_X |f_n - f|^p = \\ &= \frac{1}{\epsilon^p} (\|f_n - f\|_p)^p \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0 \end{aligned}$$

2. $f_n \xrightarrow{\mu} f$ Тогда $\exists n_k \mid f_{n_k} \rightarrow f$ почти везде.

Тогда $|f| \leq g$ п. в.

$|f_n - f|^p \leq (2g)^p$ – сумм. функции т. к. $g \in L_p$

$(\|f_n - f\|_p)^p = \int_X |f_n - f|^p d\mu \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$ (по теореме Лебега)

30 Полнота L^p

$L_p(E, \mu)$ $1 \leq p < \infty$ – полное

То есть любая фундаментальная последовательность сходится по норме $\|f\|_p$.

$$(\forall \epsilon > 0 \exists N \forall n, k \|f_n - f_k\|_p < \epsilon) \Rightarrow (\exists f : \|f_n - f\|_p \rightarrow 0)$$

Доказательство:

1. Построим f .

Рассмотрим фундаментальную последовательность f_n .

$$\exists N_1 \text{ при } n_1, k > N_1 \quad \|f_{n_1} - f_k\| < \frac{1}{2}$$

$$\exists N_2 \text{ при } n_2, k > N_2, N_1 \quad \|f_{n_2} - f_k\| < \frac{1}{4}$$

...

$$\text{Тогда: } \sum_{k=1}^{\infty} \|f_{n_{k+1}} - f_{n_k}\| < 1$$

$$f = \lim_{k \rightarrow \infty} f_{n_k}$$

Докажем, это функция f корректно задана:

$$\bullet S_N(x) := \sum_{k=1}^N |f_{n_{k+1}} - f_{n_k}|$$

$$\|S_N\|_p \leq \sum_{k=1}^N \|f_{n_{k+1}} - f_{n_k}\| < 1$$

$$\text{Тогда по Теореме Фату: } \|S\|_p \leq 1$$

Тогда $|S|^p$ — суммируема

Тогда $S(x)$ конечна при п. в. x и ряд $\sum f_{n_{k+1}} - f_{n_k}$ абс. сходится, а значит и просто сходится при п. в. x

$$f := f_{n_1} + \sum f_{n_{k+1}} - f_{n_k} \text{ т. е. } f = \text{п. в. } \lim_{k \rightarrow \infty} f_{n_k}$$

2. Проверим, что $f_n \rightarrow f$ в L_p

$$\text{Т. к. } f_n - \text{фунд.}, \text{ то } \forall \epsilon > 0 \exists N \forall n, n_k > N \quad \|f_n - f_{n_k}\| < \epsilon \Rightarrow \\ \|f_n - f_{n_k}\|^p = \int_E |f_n - f_{n_k}|^p d\mu < \epsilon^p$$

$$\text{Тогда по теореме Фату: } \int_E |f - f_n|^p \leq \epsilon^p$$

$$\text{Тогда } \forall \epsilon > 0 \exists N \forall n > N \quad \|f - f_n\|_p < \epsilon$$

Замечание: L_∞ — полное (упражнение)

31 Лемма Урысона

X — нормальное топологическое пространство, то есть:

1. Все одноточечные множества замкнуты.

2. Любые два непересекающихся замкнутых множества отделимы окрестностями:

A, B — замкнуты, $A \cap B = \emptyset \Rightarrow \exists A_1, B_1$ — открыты, $A_1 \cap B_1 = \emptyset$,
 $A \subset A_1, B \subset B_1$.

F_0, F_1 — замкнуты, $F_0 \cap F_1 = \emptyset$.

Тогда: $\exists f : X \rightarrow [0, 1]$, непрерывная (в смысле топологического определения непрерывности), равная 0 на F_0 и равная 1 на F_1 .

Доказательство:

1. Нормальное пространство - \forall замкнутого $F_0 \forall$ открытого $G F_0 \subset G$
 \exists открытое $U(F_0) : F_0 \subset U(F_0) \subset \overline{U(F_0)} \subset G$
2. Пусть $G = F_1^c$ и оставим F_0 . Обозначим как $G_0 = U(F_0)$ и $G_1 = G$.
3. Рассмотрим открытое $G_{1/2} : \overline{G_0} \subset G_{1/2} \subset \overline{G_{1/2}} \subset G_1$. Дальше так можно построить для рац чисел с знаменателем степенью двойки (дальше такие числа - двоично рациональные).
4. $f(x) = \inf(\alpha : x \in G_\alpha)$ и α - дв.рац. Нужно проверить непрерывность. То есть для любого открытого множества прообраз открыт. А для этого достаточно проверить, что $f^{-1}(-\infty, s) = \cup_{\alpha < s} G_\alpha$ и $f^{-1}(-\infty, s] = \cap_{\alpha > s} \overline{G_\alpha}$.
5. \supset . очевидно из определения f. $x \in G_\alpha \Rightarrow f(x) \leq \alpha \Rightarrow f(x) < s \Rightarrow x \in f^{-1}(-\infty, s)$
6. \subset . Пусть $f(x) = s_0 < \alpha < s$. Тогда $x \in G_\alpha$ /* $f(x) = s_0 = \inf(\beta : x \in G_\beta)$ Если бы $x \notin G_\alpha$, то $x \in G_\beta$ при $\beta < \alpha$ и $\infty > s_0$.
7. Первое доказано, теперь второе.
8. \subset очевидно как выше
9. В обратную сторону - пусть существует $\beta \in (s, \alpha)$. Тогда $\overline{G_\beta} \subset G_\alpha$, т.е. $\cap_{\text{все } \alpha > s} G_\alpha \supset \cap_{\text{некоторые } \beta > s} G_\beta \supset \cap_{\text{все } \beta > s} \overline{G_\beta}$

32 Плотность в L^p непрерывных финитных функций

$(\mathbb{R}^m, \mathbb{A}, \lambda_m)$

$E \subset \mathbb{R}^m$ — изм. Тогда множество финитных непрерывных функций плотно в $L_p(E, \lambda_m)$, $p \in [1; +\infty]$

Доказательство:

1. Раскроем определение плотности: $\forall f \in L_p(E, \mu) \forall \epsilon > 0 \exists \varphi \in C_0(\mathbb{R}^m) : \|f - \varphi\|_p < \epsilon$. Таким образом достаточно научиться приближать f и φ ступенчатыми функциями f_n : $\|f - f_n\|_p < \epsilon/2$ и $\|\varphi - f_n\|_p < \epsilon/2$

2. **TODO!**

33 Теорема о непрерывности сдвига

Обозначения:

$$f_h := f(x + h)$$

$[0, T] \subset \mathbb{R}$. Будем считать, что $L_p[0, T]$ состоит из T -периодических функций $\mathbb{R} \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$. Отсюда $\int_0^T f = \int_a^{a+T} f$.

$$\tilde{C}[0, T] = \{f \in C[0, T] : f(0) = f(T)\}. \|f\| = \max_{x \in [0, T]} |f(x)|$$

NB: $f \in \tilde{C}[0, T] \Rightarrow f$ равномерно непрерывна (по т. Кантора).

Формулировка:

1. f — рвнм. непр. на \mathbb{R}^m . Тогда $\|f - f_h\|_\infty \rightarrow 0$ при $h \rightarrow 0$.
2. $1 \leq p < +\infty$ $f \in L_p(\mathbb{R}^m, \lambda_m)$. Тогда $\|f - f_h\|_p \rightarrow 0$.
3. $f \in \tilde{C}[0, T]$. Тогда $\|f - f_h\|_\infty \rightarrow 0$.
4. $1 \leq p < +\infty$ $f \in L_p[0; T]$. Тогда $\|f - f_h\|_p \rightarrow 0$.

Доказательство:

- 1 и 3 свойства следуют из определения рвнм. непр-ти: $\forall \epsilon > 0 \exists \delta > 0 \forall x \in \mathbb{R}^m \forall h : |h| < \delta$ верно, что $|f(x) - f(x+h)| < \epsilon$, то есть $\|f - f_h\|_\infty < \epsilon$ (это для св-ва 1, во втором случае x из $[0, T]$).
- 4 пункт: Подберем непрерывную функцию g , которая хорошо приближает f . $\|f - g\|_p < \frac{\epsilon}{3}$. Тогда $\|f_h - g_h\| < \frac{\epsilon}{3}$ (очевидно, т.к. это сдвиг и интеграл не меняется). $\|g_h - g\|^p = \int_0^T \|g(x+h) - g(x)\|^p \leq \epsilon_0^p T = \frac{\epsilon}{3}$ (можно так подобрать ϵ_0 . Тогда: $\|f_h - f\| \leq \|f_h - g_h\| + \|g_h - g\| + \|g - f\| \leq \frac{\epsilon}{3} + \frac{\epsilon}{3} + \frac{\epsilon}{3} = \epsilon$, чтд.
3. 2й пункт — аналогично, но возьмем шар $B(0, R)$ и финитную функцию g , что $g \equiv 0$ вне этого шара. Остальное — аналогично.

34 Теорема об интеграле с функцией распределения

Проверить формулировку, тут, вроде, какая-то херня написана чё за измеримость по Борелю???

(\mathbb{R}, B, X)

$f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}, f \geq 0$, изм. по Борелю, п.в. конечн.

$h : X \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$ с функцией распределения $H(t)$

μ_H — мера Бореля-Стилтьеса (мера Лебега-Стилтьеса на B)

$$\text{Тогда } \int_X f(h(x)) d\mu(x) = \int_{\mathbb{R}} f(t) d\mu_H(t)$$

Доказательство: Следует из теоремы о вычислении интеграла по взвешенному образу меры, положив $\langle Y, C, \nu \rangle = \langle \mathbb{R}, B(\mathbb{R}), h(\mu) \rangle, \Phi = h, \omega = 1$

35 Теорема о свойствах сходимости в гильбертовом пространстве

1. $x_n \rightarrow x, y_n \rightarrow y \Rightarrow \langle x_n, y_n \rangle \rightarrow \langle x, y \rangle$

2. $\sum x_k$ сходится, тогда $\forall y : \sum \langle x_k, y \rangle = \langle \sum x_k, y \rangle$
3. $\sum x_k$ - ортогональный ряд, тогда $\sum x_k$ - сх $\Leftrightarrow \sum |x_k|^2$ сходится, при этом $|\sum x_k|^2 = \sum |x_k|^2$

Доказательство

1. $|\langle x_k, y_k \rangle - \langle x, y \rangle| = |\langle x_k, y_k \rangle - \langle x_k, y \rangle + \langle x_k, y \rangle - \langle x, y \rangle| \leq |\langle x_k, y_k - y \rangle| + |\langle x_k - x, y \rangle| \leq |x_k| \cdot |y_k - y| + |x_k - x| \cdot |y| \rightarrow 0$ (так как $\text{огр} \cdot \text{б.м.} + \text{б.м.} \cdot \text{огр} \rightarrow 0$)

2. $S_n = \sum_{k=1}^n x_k$

$$\langle \sum_{k=1}^n x_k, y \rangle = \sum_{k=1}^n \langle x_k, y \rangle$$

Устремляя n к ∞ , получаем требуемое равенство

3. Обозначим $C_n := \sum_{k=1}^n |x_k|^2$

$$|S_n|^2 = \langle \sum_{k=1}^n x_k, \sum_{j=1}^n x_j \rangle = \sum_{k,j} \langle x_k, x_j \rangle = \sum_{k=1}^n \langle x_k, x_k \rangle \quad (\text{так как } k \neq j \Rightarrow \langle x_k, x_j \rangle = 0) = \sum_{k=1}^n |x_k|^2 = C_n$$

Аналогично, $||S_n|^2 - |S_m|^2| = |C_n - C_m|$

Тогда $C_n, |S_n|^2$ фундаментальны одновременно \Rightarrow сходятся одновременно при устремлении n к ∞

36 Теорема о коэффициентах разложения по ортогональной системе

$\{e_k\}$ — ортогональная система в \mathbb{H} , $x \in \mathbb{H}, x = \sum_{k=1}^{+\infty} c_k \cdot e_k$

Тогда:

1. $\{e_k\}$ — Л.Н.З.

$$2. c_k = \frac{\langle x, e_k \rangle}{\|e_k\|^2}$$

3. $c_k \cdot e_k$ — проекция x на прямую $\{te_k \mid t \in \mathbb{R} \text{ (или } \mathbb{C})\}$

Иными словами, $x = c_k \cdot e_k + z$, где $z \perp e_k$

Доказательство:

1. Пусть $\sum_{k=1}^N \alpha_k e_k = 0$. Умножим скалярно на e_m ($1 \leq m \leq N$)

Получим: $\alpha_m \|e_m\|^2 = 0 \Rightarrow \alpha_m = 0 \Rightarrow$ комб. тривиальная \Rightarrow Л.Н.З.

$$2. \langle x, e_m \rangle = \sum_{k=1}^{+\infty} \langle c_k e_k, e_m \rangle = c_m \cdot \|e_m\|^2 \text{ (верно в силу сходимости ряда)}$$

3. $x = c_k \cdot e_k + z$. Доказать: $z \perp e_k$.

$$\langle z, e_k \rangle = \langle x - c_k e_k, e_k \rangle = c_k \cdot \|e_k\|^2 - c_k \cdot \|e_k\|^2 = 0$$

37 Теорема о свойствах частичных сумм ряда Фурье. Неравенство Бесселя

$\{e_k\}$ — ортогональная система в \mathbb{H} , $x \in \mathbb{H}$, $n \in \mathbb{N}$

$$S_n = \sum_{k=1}^n c_k(x) e_k, \quad \mathcal{L} = \text{Lin}(e_1, e_2, \dots, e_n) \subset \mathbb{H}$$

Тогда:

1. S_n — орт. проекция x на пр-во \mathcal{L} . Иными словами $x = S_n + z$, $z \perp \mathcal{L}$

2. S_n — наилучшее приближение x в \mathcal{L} ($\|x - S_n\| = \min_{y \in \mathcal{L}} \|x - y\|$)

$$3. \|S_n\| \leq \|x\|$$

Доказательство:

$$1. (a) z = x - S_n$$

$$(b) z \perp \mathcal{L} \Leftrightarrow \forall k = 1, 2 \dots n : z \perp e_k$$

$$(c) \langle z, e_k \rangle = \langle x, e_k \rangle - \langle S_n, e_k \rangle = c_k \|e_k\|^2 - c_k \|e_k\|^2 = 0$$

$$2. \|x - y\|^2 = \|S_n + z - y\|^2 = \|(S_n - y) + z\|^2 = \|S_n - y\|^2 + \|z\|^2 \geq \|z\|^2 = \|x - S_n\|^2$$

$$3. \|x\|^2 = \|S_n\|^2 + \|z\|^2 \text{ (теорема о сумме орт. ряда)} \geq \|S_n\|^2$$

Следствие: Неравенство Бесселя

$$\forall \{e_k\} - \text{O.C.} : \sum_{k=1}^{+\infty} |c_k(x)|^2 \cdot \|e_k\|^2 \leq \|x\|^2$$

38 Теорема Рисса – Фишера о сумме ряда Фурье. Равенство Парсеваля

$\{e_k\}$ – орт. сист. в \mathbb{H} , $x \in \mathbb{H}$

Тогда:

$$1. \text{Ряд Фурье } \sum_{k=1}^{+\infty} c_k(x) e_k \text{ сходится в } \mathbb{H}$$

$$2. x = \sum_{k=1}^{+\infty} c_k e_k + z \Rightarrow \forall k \ z \perp e_k$$

$$3. x = \sum_{k=1}^{+\infty} c_k e_k \Leftrightarrow \sum_{k=1}^{+\infty} |c_k|^2 \|e_k\|^2 = \|x\|^2$$

Доказательство:

$$1. \text{Ряд Фурье – ортогональный ряд} \\ \text{его сходимость} \Leftrightarrow \text{сходимости } \sum_{k=1}^{+\infty} |c_k|^2 \|e_k\|^2$$

$$\sum_{k=1}^{+\infty} |c_k|^2 \|e_k\|^2 \leq \|x\|^2 \text{ по неравенству Бесселя}$$

$$2. \langle z, e_k \rangle = \langle x - \sum c_i e_i, e_k \rangle = \langle x, e_k \rangle - \sum_{i=1}^{+\infty} \langle c_i(x) e_i, e_k \rangle = 0$$

3. \Rightarrow - утв. 3 теоремы о св-вах сх-ти в гильбертовом пр-ве

\Leftarrow Из п. 2 ряд ортог.

$$\|x\|^2 = \|\sum c_k e_k\|^2 + \|z\|^2 = \sum |c_k|^2 \|e_k\|^2 + \|z\|^2 = \|x\|^2 + \|z\|^2 \Rightarrow z = 0$$

39 Теорема о характеристике базиса

$\{e_k\}$ — ортогональная система в \mathbb{H}

Тогда эквивалентны следующие утверждения:

1. $\{e_1\}$ — базис.

2. $\forall x, y \in \mathbb{H} \quad \langle x, y \rangle = \sum c_k(x) \overline{c_k(y)} \|e_k\|^2$ (обобщенное уравнение замкнутости)

3. $\{e_k\}$ — замкнутая система.

4. $\{e_k\}$ — полная система.

5. $Lin(e_1, e_2, \dots)$ — плотна в \mathbb{H}

Доказательство:

39.1 $1 \Rightarrow 2$

$x = \sum c_k(x) e_k$ — единственно (из геом. соображений: $c_k e_k$ — проекция)

$$\langle e_k, y \rangle = \langle y, e_k \rangle = \overline{c_k(y)} \|e_k\|^2$$

$$\langle x, y \rangle = \sum c_k(x) \langle e_k, y \rangle = \sum c_k(x) \overline{c_k(y)} \|e_k\|^2$$

39.2 $2 \Rightarrow 3$

$$y := x$$

$$\|x\|^2 = \sum |c_k(x)|^2 \|e_k\|^2 \quad (\text{см. п. 3 из опр.})$$

39.3 $3 \Rightarrow 4$

Пусть $\forall k \quad x_0 \perp e_k$

$$c_k(x_0) = \frac{\langle x_0, e_k \rangle}{\|e_k\|^2} = 0$$

$$\|x_0\|^2 = \sum |c_k(x_0)|^2 \|e_k\|^2 = 0 \quad (\text{см. п. 2 из опр.})$$

39.4 $4 \Rightarrow 1$

$$x = \sum_{k=1}^{+\infty} c_k e_k + z \Rightarrow (\text{т. Рисса-Фишера (2)}) \quad \forall k \quad z \perp e_k \Rightarrow (\text{из полноты}) \quad z = 0$$

(см. п. 1 из опр.)

39.5 $4 \Rightarrow 5$

Пусть $ClLin(e_1, e_2, \dots) \neq \mathbb{H}$, $x \in \mathbb{H} \setminus ClLin(e_1, e_2, \dots)$

$$\text{из т. Рисса-Фишера (2): } x = \sum_{k=1}^{+\infty} c_k e_k + z \Rightarrow \forall k \quad z \perp e_k \Rightarrow x = \sum_{k=1}^{+\infty} c_k e_k \Rightarrow$$

$$x \in ClLin(e_1, e_2, \dots)$$

Противоречие.

39.6 $5 \Rightarrow 4$

$$\forall k \quad x_0 \perp e_k \Rightarrow x_0 \perp Lin(e_1, e_2, \dots) \Rightarrow x_0 \perp ClLin(e_1, e_2, \dots) (= \mathbb{H}) \Rightarrow x_0 \perp x_0 \Rightarrow \|x_0\|^2 = 0 \Rightarrow x_0 = 0$$

40 Лемма о вычислении коэффициентов тригонометрического ряда

Пусть $S_n \rightarrow f$ в $L_1(-\pi, \pi]$

Тогда:

$$a_k = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \cos kx \, dx \quad k = 0, 1, 2, \dots$$

$$b_k = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \sin kx \, dx \quad k = 0, 1, 2, \dots$$

$$c_k = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) e^{-ikx} \, dx \quad k = 0, 1, 2, \dots$$

Доказательство:

Почему нельзя сказать, что коэффициенты — это коэффициенты ряда Фурье, а потому вычисляются как скалярные произведения???

$$S_n = \frac{a_0}{2} + \sum_{j=1}^n a_j \cos jx + b_j \sin jx \quad (- \text{ это } T_n)$$

При $n \geq k$:

$$1. \int_{-\pi}^{\pi} S_n(x) \cos kx \, dx = \int_{-\pi}^{\pi} a_k \cos^2 kx \, dx = \pi a_k \quad (\text{в силу ортогональности триг системы})$$

$$2. \left| \int_{-\pi}^{\pi} S_n(x) \cos kx \, dx - \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \cos kx \, dx \right| \leq \int_{-\pi}^{\pi} |S_n(x) - f(x)| \cdot |\cos kx| \, dx \leq \int_{-\pi}^{\pi} |S_n(x) - f(x)| \, dx \rightarrow 0$$

Из 1 и 2 следует равенство для a_k . Аналогично доказывается и для других.

41 Теорема Римана–Лебега

$E \subset \mathbb{R}^1$ — измеримо

$f \in L_1(E, \lambda)$, λ - мера Лебега

Тогда:

$$\int_E f(x) e^{ikx} \, dx \xrightarrow[k \rightarrow +\infty]{} 0$$

$$\int_E f(x) \cos(kx) \, dx \xrightarrow[k \rightarrow +\infty]{} 0$$

$$\int_E f(x) \sin(kx) dx \xrightarrow{k \rightarrow +\infty} 0$$

Доказательство:

Пусть $f \equiv 0$ вне E , тогда можно считать, что $f \in L^1(\mathbb{R}^1)$

Обозначим $e(x) = \cos(x)$, или $\sin(x)$, или e^{ix} , в зависимости от ситуации. Заметим, что $e(t + \pi) = -e(t)$

$$\begin{aligned} \int_{\mathbb{R}} f(t) e(kt) dt & \stackrel{t=\tau+\frac{\pi}{k}}{=} \int_{\mathbb{R}} f(\tau + \frac{\pi}{k}) e(k \cdot (\tau + \frac{\pi}{k})) = - \int_{\mathbb{R}} f(\tau + \frac{\pi}{k}) e(k\tau) \\ \int_{\mathbb{R}} f(t) e(kt) &= \frac{1}{2} \int_{\mathbb{R}} f(t) e(kt) - \frac{1}{2} \int_{\mathbb{R}} f(\tau + \frac{\pi}{k}) e(kt) = \frac{1}{2} \int_{\mathbb{R}} (f(t) - f(t + \frac{\pi}{k})) e(kt) \end{aligned}$$

$$\left| \int_{\mathbb{R}} f(t) e(kt) \right| \leq \frac{1}{2} \int_{\mathbb{R}} |f(t) - f(t + \frac{\pi}{k})| dt \quad (\text{так как } |e(kt)| \leq 1) \xrightarrow{k \rightarrow +\infty} 0,$$

по непрерывности сдвига

42 Принцип локализации Римана

$$f, G \in L_1[-\pi, \pi]$$

$$x_0 \in R, \delta > 0$$

$$f \equiv g \text{ на } (x_0 - \delta, x_0 + \delta)$$

Тогда:

$$S_n(f, x_0) - S_n(g, x_0) \rightarrow 0$$

Доказательство:

$$h := f - g \equiv 0 \text{ на } (x_0 - \delta, x_0 + \delta)$$

$$S_n(h, x_0) = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} h(x_0 + t) (ctg(\frac{t}{2}) \sin(nt) + \cos(nt)) dt \quad (57 \text{ теорема})$$

$$h_1 = \frac{1}{2} h(x_0 + t)$$

$$h_2 = \frac{1}{2} h(x_0 + t) ctg(\frac{t}{2})$$

$$S_n(h, x_0) = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} h_1 \cos(nt) + h_2 \sin(nt) = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{-\delta} h_1 \cos(nt) + h_2 \sin(nt) +$$

$$\frac{1}{\pi} \int_{-\delta}^{\delta} 0 + \frac{1}{\pi} \int_{\delta}^{\pi} h_1 \cos(nt) + h_2 \sin(nt)$$

Оценим:

$$|h_2(t)| \leq \frac{1}{2} |h(x_0 + t) \operatorname{ctg}(\frac{t}{2})| \leq \frac{1}{2} |h(x_0 + t)| \frac{2}{\delta} \quad (\text{так как } |\operatorname{ctg}(x)| < \frac{1}{x}, \text{ а } |t| > |\delta|)$$

Тогда $h_1, h_2 \in L_1$, тогда по теореме Римана-Лебега два крайних интеграла стремятся к 0.

43 Признак Дини. Следствия

$$f \in L_1[-\pi, \pi]$$

$$x_0 \in R$$

$$S \in R$$

$$(*) \int_0^\pi \frac{|f(x_0+t) - 2S + f(x_0-t)|}{t} dt \text{ сходитсЯ}$$

Тогда:

$$S_n(f, x_0) \rightarrow S$$

$$\text{Доказательство: } D_n(t) = \frac{\sin((n+\frac{1}{2})t)}{2\pi \sin(\frac{t}{2})}$$

$$\phi(t) = f(x_0 + t) - 2S + f(x_0 - t)$$

$$S_n(f, x_0) - S = \int_{-\pi}^\pi (f(x_0 + t) - S) D_n(t) dt =$$

$$= \int_0^\pi (f(x_0 + t) - S) D_n(t) dt + \int_{-\pi}^0 (f(x_0 + t) - S) D_n(t) dt = \int_0^\pi \phi(t) D_n(t) dt$$

Введём h_1, h_2 :

$$h_1(t) := \begin{cases} \frac{1}{2}\phi(t), & t \in [0, \pi] \\ 0, & t \in [-\pi, 0) \end{cases}$$

$$h_2(t) := \begin{cases} \frac{1}{2}\phi(t) \operatorname{ctg}(\frac{t}{2}), & t \in [0, \pi] \\ 0, & t \in (-\pi, 0) \end{cases}$$

Покажем что h_1 суммируема

$$\int_{-\pi}^\pi |h_1(t)| dt \leq \frac{1}{2} \int_{-\pi}^\pi |\phi(t)| dt \leq \frac{1}{2} \int_{-\pi}^\pi (|f(x_0 + t)| + 2|S| + |f(x_0 - t)|) dt < +\infty$$

(поскольку f суммируема)

Покажем что h_2 суммируема

$$|\operatorname{ctg}(\frac{t}{2})| < \frac{2}{|t|}, t \in [-\pi, \pi]$$

$$\frac{1}{2} \int_0^\pi |\phi(t)| |\operatorname{ctg}(\frac{t}{2})| dt \leq \int_0^\pi \frac{|\phi(t)|}{t} dt < +\infty \text{ по } (*)$$

Тогда

$$\int_0^\pi \phi(t) D_n(t) = C \cdot \int_0^\pi \phi(t) (\operatorname{ctg}(\frac{t}{2}) \sin(nt) + \cos(nt)) = (C - \text{хз какая кон-}$$

статна, что-то из ядра Дирихле)

$$= C \cdot \int_{-\pi}^\pi h_1 \cos(nt) + h_2 \sin(nt) \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0 \text{ (по теореме Римана-Лебега)}$$

Следствие1:

\exists 4 предела

$$\lim_{t \rightarrow \pm 0} \frac{f(x_0+t) - f(x_0 \pm 0)}{t}$$

Тогда:

$$\text{Ряд фурье сходится в } x_0 \text{ как } \frac{f(x_0+0) + f(x_0-0)}{2}$$

Следствие2:

$$f \in L_1[-\pi, \pi]$$

f непрерывна в x_0

\exists конечные $f'_+(x_0), f'_-(x_0)$

Тогда:

$$S_n(f, x_0) \rightarrow f(x_0)$$

44 Корректность свертки

$$f, K \in L_1[-\pi, \pi]$$

Тогда: $(f * K)$ – корректно заданная функция из $L_1[-\pi, \pi]$

Доказательство:

- Докажем, что $g(x, t) = f(x - t)K(t)$ – измерима
– $K(t)$ – измерима, как функция из L_1

– $\phi(x, t) = f(x - t)$. Это функция принимает одинаковые значения на $t = x - C$.

Поэтому: $R^2(\phi < a) = V^{-1}(E_{a'} \times R)$, где $V(x, t) = (x - t, t)$

$E_{a'} = V(R(f < a))$ – измеримо, так как f – измеримо. **Что за бред, V действует из R^2 , а тут пытаются сделать из R**

Поэтому $R^2(\phi < a)$ – измеримо.

– Поэтому g – измерима, как произведение измеримых

• Проверим, что $g \in L_1([-\pi, \pi] \times [-\pi, \pi])$

$$\iint_{[-\pi, \pi]} |g| d\lambda^2 = \int_{-\pi}^{\pi} (|K(t)| \int_{-\pi}^{\pi} |f(x - t)| dx) dt = \|f\|_1 \|K\|_1 < +\infty$$

• По теореме Фубини $\int_{-\pi}^{\pi} g(x, t) dt$ – суммируемая при в. п. в. x

• Тогда свертка лежит в $L_1[-\pi, \pi]$

45 Свойства свертки функции из L^p с функцией из L^q

$$f \in L^p; K \in L^q$$

$$1 \leq p \leq +\infty; \frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$$

Тогда:

• $f * K$ – непр. на $[-\pi, \pi]$

$$\|f * K\|_{\infty} \leq \|K\|_q \|f\|_p$$

Доказательство: Это нер-во Гельдера

$$\text{п. 2 } |(f * K)(x)| = \left| \int_{-\pi}^{\pi} f(x - t) K(t) dt \right| \underset{\text{нер-во Гельдера}}{\leq} \|K\|_q \|f\|_p$$

$$\sup |f * K| \leq \|f\|_p \|K\|_q \Rightarrow \text{пункт 2}$$

(Причем нер-во Гельдера выполнено и для $p = \infty$)

п. 1 $-p < +\infty$

$$|(f*K)(x+h)-(f*K)(x)| = \left| \int_{-\pi}^{\pi} (f(x+h-t)-f(x-t))K(t)dt \right| \underset{\text{нер-во Гельдера}}{\leq}$$

$$\left(\int_{-\pi}^{\pi} |f(x+h-t)-f(x-t)|^p dt \right)^{1/p} \left(\int_{-\pi}^{\pi} |K(t)|^q dt \right)^{1/q} = \|K\|_q \left(\int_{-\pi}^{\pi} |f(x+h-t)-f(x-t)|^p dt \right)^{1/p}$$

$$= \|K\|_q \left(\int_{-\pi}^{\pi} |f(y+h)-f(y)|^p dy \right)^{1/p} =$$

Это неправда, почему границы интегрирования не сменились?

Правда! Потому что функции продолжены по периодичности!!!

$$= \|K\|_q \|f(y+h)-f(y)\|_p \xrightarrow{\text{по непр. сдвига}} 0$$

$-p = +\infty$

$$|(f*K)(x+h)-(f*K)(x)| = \left| \int_{-\pi}^{\pi} (f(x+h-t)-f(x-t))K(t)dt \right| \underset{\text{нер-во Гельдера}}{\leq}$$

$$\left(\int_{-\pi}^{\pi} |K(t)|^q dt \right)^{1/q} \cdot \operatorname{esssup}_{t \in [-\pi, \pi]} |f(x+h-t)-f(x-t)| =$$

$$\|K\|_q \cdot \operatorname{esssup}_{t \in [x+\pi, x-\pi]} |f(t+h)-f(t)| \xrightarrow{\text{по непр. сдвига}} 0$$

46 Формула Грина

$D \subset \mathbb{R}^2$ – компакт, связное, односвязное, ориентировано

δD – C^2 -гладкая кривая, тоже ориентировано

D и δD ориентированы согласовано

P, Q – функции, гладкие в открытой области $O \supset D$

Тогда:

$$\iint_D \left(\frac{\partial Q}{\partial x} - \frac{\partial P}{\partial y} \right) dx dy = \int_{\delta D} (P(x, y) dx + Q(x, y) dy)$$

Доказательство:

Докажем для областей вида "криволинейный четырехугольник", т.е.

$x \in [a; b]$

$y \in [\phi_1(x); \phi_2(x)]$, где $\phi_2(x) > \phi_1(x)$

Представляется в аналогичном виде, относительно y

Ориентируем обход нашего четырехугольника против часовой стрелки.

Назовем пути по сторонам $\gamma_1, \gamma_2, \gamma_3, \gamma_4$ начиная с нижней против часовой стрелки соответственно.

Из линейности интеграла по векторному полю следует, что для доказательства достаточно проверить:

$$-\iint_D \frac{\delta P}{\delta y} dx dy = \int_{\delta D} P dx$$

Почему второе проверять не нужно?

1. Преобразуем левую часть:

$$\begin{aligned} -\iint_D \frac{\delta P}{\delta y} dx dy &= -\int_a^b dx \int_{\phi_1(x)}^{\phi_2(x)} P'_y dy = -\int_a^b P(x, y) \Big|_{y=\phi_1(x)}^{y=\phi_2(x)} dx = \\ &= \int_a^b P(x, \phi_1(x)) dx - \int_a^b P(x, \phi_2(x)) dx \end{aligned}$$

2. Преобразуем правую часть:

$$\begin{aligned} \int_{\delta D} (P dx + 0 dy) &= \int_{\gamma_1} + \int_{\gamma_2} + \int_{\gamma_3} + \int_{\gamma_4} \\ &= \int_a^b P(x, \phi_1(x)) dx + 0 + \int_b^a P(x, \phi_2(x)) dx + 0 = \\ &= \int_a^b P(x, \phi_1(x)) dx - \int_a^b P(x, \phi_2(x)) dx \end{aligned}$$

Левая и правая части равны.

Если область более сложная - порежем на простые. Зафиксируем направление обхода, посчитаем на каждой.

При фиксированном направлении обхода пути на границах разрезов учитываются дважды с противоположными знаками, то есть в итоге имеем обход границы всей фигуры.

Из компактности и гладкости области следует, что допускается счетное количество разрезов.

47 Формула Стокса

Ω – эллиптическая, гладкая, двусторонняя поверхность, C^2 –гладкое;
 n_0 – сторона

$\delta\Omega$ - ориентирована согласовано с n_0

(P, Q, R) – векторное поле на Ω , заданное в O - откp. : $\Omega \subset O \subset \mathbb{R}^3$

Тогда:

$$\int_{\delta\Omega} (Pdx + Qdy + Rdz) = \iint_{\Omega} ((R'_y - Q'_z)dydz + (P'_z - R'_x)dzdx + (Q'_x - P'_y)dxdy)$$

Доказательство:

Из соображений линейности интеграла по векторному полю достаточно проверить:

$$\int_{\delta\Omega} Pdx = \iint_{\Omega} (P'_z dzdx - P'_y dxdy)$$

Параметризуем область: $\Omega \leftrightarrow \left\langle \begin{matrix} x(u, v) \\ y(u, v) \\ z(u, v) \end{matrix} \right\rangle$

Пусть G – наша область в координатах (u, v) , L – граница Ω в новых координатах, тогда:

$$\int_{\delta\Omega} Pdx = \int_L P(x(u, v), y(u, v), z(u, v))(x'_u du + x'_v dv) = \int_L Px'_u du + Px'_v dv \stackrel{\Gamma_{\text{рин}}}{=}$$

$$\iint_G ((P(x, y, z)x'_v)'_u - (P(x, y, z)x'_u)'_v) dudv =$$

$$\iint_G (P'_z(z'_u x'_v - z'_v x'_u) - P'_y(y'_v x'_u - y'_u x'_v)) dudv =$$

$$\iint_G P'_z \begin{vmatrix} z'_u & z'_v \\ x'_u & x'_v \end{vmatrix} dudv - P'_y \begin{vmatrix} x'_u & x'_v \\ y'_u & y'_v \end{vmatrix} dudv =$$

$$\iint_{\Omega} (P'_z dzdx - P'_y dxdy)$$

что и требовалось доказать

48 Формула Гаусса–Остроградского

$V = \{(x, y, z) \in \mathbb{R}^3 : (x, y) \in G, f(x, y) \leq z \leq F(x, y)\}$, $G \subset \mathbb{R}^2$, ∂G — гладкая кривая в \mathbb{R}^2 , $F \in C^1(G)$ (кавычки означают "включая границу, то есть с более широкой гладкой областью"), ∂V — внешняя сторона, $R : O(V) \rightarrow \mathbb{R}$. Тогда

$$\iiint_V \frac{\partial R}{\partial z} dx dy dz = \iint_{\partial V} R dx dy$$

Доказательство:

$\partial V = \Omega_F \cup \Omega_{cil} \cup \Omega_f$ (границы графика F , f и цилиндра между ними)

$$\begin{aligned} \iiint_V \frac{\partial R}{\partial z} dx dy dz &= \iint_G dx dy \int_{f(x,y)}^{F(x,y)} \frac{\partial R}{\partial z} dz = \\ &= \iint_G (R(x, y, F(x, y)) - R(x, y, f(x, y))) dx dy = (\text{см. пример после опр.} \\ &\text{инт. 2 рода}) \\ &= \iint_{\Omega_F} R dx dy - \left(- \iint_{\Omega_f} R dx dy\right) + 0 = (\text{так как проекция } \Omega_{cil} \text{ лежит в } \partial G) \end{aligned}$$

Откуда эта формула?

$$\begin{aligned} &= \iint_{\Omega_F} R dx dy + \iint_{\Omega_f} R dx dy + \iint_{\Omega_{cil}} R dx dy = \\ &= \iint_{\partial V} R dx dy \end{aligned}$$

49 Соленоидальность бездивергентного векторного поля

A - соленоидально $\Leftrightarrow \operatorname{div}(A) = 0$

$A \in C^1$, O — хорошая область.

Доказательство:

\Rightarrow . Тривиально : $A = \operatorname{rot}(B)$. т.е.

$A_1 = (B_3)'_y - (B_2)'_z$, $A_2 = (B_1)'_z - (B_3)'_x$, $A_3 = (B_2)'_x - (B_1)'_y$ (система ***)

тогда $(A_1)'_x + (A_2)'_y + (A_3)'_z = 0$, что и требовалось доказать.

\Leftarrow . $\operatorname{div}(A) = 0$. Найдем B . Нужно решить относительно B систему *** (выше). Нагло примем $B_3 \equiv 0$. Тогда система будет состоять из простых уравнений:

$$-(B_2)'_z = A_1 \quad (1), \quad (B_1)'_z = A_2 \quad (2), \quad (B_2)'_x - (B_1)'_y = A_3 \quad (3).$$

$$\text{Из (1) : } B_2(x, y, z) = -\int_{z_0}^z A_1(x, y, z) dz + \phi(x, y)$$

$$\text{Из (2) : } B_1(x, y, z) = \int_{z_0}^z A_2(x, y, z) dz \quad (\text{еще одна наглость! берем аналогичное } \phi \text{ равным } 0)$$

$$\text{В (3) : } -\int_{z_0}^z (A_1)'_x dz + (\phi)'_x - \int_{z_0}^z (A_2)'_y dz = A_3.$$

Но т.к. $\operatorname{div}(A) = 0$, то $\int_{z_0}^z (A_3)'_z dz + \phi'_x = A_3$ (это в последнее равенство подставили $(A_3)'_z = -(A_1)'_x - (A_2)'_y$). То есть $A_3(x, y, z) - A_3(x, y, z_0) + \phi'_x = A_3(x, y, z) \Rightarrow \phi'_x = A_3(x, y, z_0)$, ну а это значит $\phi = \int_{x_0}^x A_3(x, y, z) dx$.

Мы нашли ϕ , такоо ϕ найдется, подставим теперь во все равенства выше и получим верными равенства и выражения для B_1, B_2, B_3 . Значит система *** для найденного B верна и значит это B таково, что $A = \operatorname{rot}(B)$, то есть A — соленоидально! чтд

50 Предельный переход под знаком интеграла при наличии равномерной сходимости или L_{loc}

50.1 При равномерной сходимости

$$f : \mathbb{X} \times \mathbb{Y} \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$$

$(\mathbb{X}, \mathbb{A}, \mu)$ — простр. с мерой

\mathbb{Y} — метр. простр. (или метризуемое)

$\forall y \ f^y(x) = f(x, y)$ — сумм. на \mathbb{X}

$$\mu X < +\infty; \quad f(x, y) \xrightarrow{y \rightarrow a} \phi(x)$$

Тогда:

• ϕ — сумм.

$$\bullet \int_X f(x, y) d\mu(x) \xrightarrow{y \rightarrow a} \int_X \phi(x) d\mu(x)$$

Доказательство: По Гейне: $y_n \rightarrow a$

При больших $n \quad \forall x \quad |f(x, y_n) - \phi(x)| < 1$

$$\Rightarrow |\phi(x)| \leq |f(x, y_n)| + 1 \Rightarrow \int_X |\phi(x)| \leq \int_X |f| + \mu X$$

Из этого следует, что ϕ – суммир.

$$\left| \int_X f(x, y_n) d\mu(x) - \int_X \phi \right| \leq \int_X |f(x, y_n) - \phi(x)| d\mu \leq \sup_{x \in X} |f(x, y_n) - \phi(x)| \mu X$$

$$\sup_{x \in X} |f(x, y_n) - \phi(x)| \mu X \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0$$

50.2 При L_{loc}

Определение L_{loc}

$$f : \mathbb{X} \times \mathbb{Y} \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$$

$(\mathbb{X}, \mathbb{A}, \mu)$ – простр. с мерой

\mathbb{Y} – метр. простр. (или метризуемое); $a \in \mathbb{Y}$

$\forall y \quad f^y(x) = f(x, y)$ – сумм. на \mathbb{X}

f удовлетворяет L_{loc} ($f \in (L_{loc})$) если:

- $\exists g : \mathbb{X} \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$ – сумм.
- $\exists U(a) \quad \forall y \in \dot{U}(a)$ при п. в. $x \in \mathbb{X} \quad |f(x, y)| \leq g(x)$

Формулировка в контексте определения:

$\phi := \lim_{y \rightarrow a} f(x, y)$ – задана при п. в. x

$f(x, y)$ удовлетворяет условию L_{loc} в точке a и мажорантой g

Тогда:

- ϕ – сумм.
- $\int_X f(x, y) d\mu(x) \xrightarrow{y \rightarrow a} \int_X \phi(x) d\mu(x)$

Доказательство: На самом деле это переформулировка Теоремы Лебега о мажорированной сходимости для случая сходимости почти везде. (см теор. № 13)

51 Правило Лейбница дифференцирования интеграла по параметру

$$f : \mathbb{X} \times \mathbb{Y} \rightarrow \overline{\mathbb{R}}$$

$(\mathbb{X}, \mathbb{A}, \mu)$ – простр. с мерой

\mathbb{Y} – метр. простр. (или метризуемое)

$\forall y \ f^y(x) = f(x, y)$ – сумм. на \mathbb{X}

$\mathbb{Y} \subset \mathbb{R}$ – промежутки

при п. в. $x \ \forall y \ \exists f'_y(x, y)$

f'_y удовлетворяет усл. L_{loc} в точке $a \in \mathbb{Y}$

Тогда:

$$\bullet \ I(y) = \int_X f(x, y) d\mu(x) \text{ – дифф. в точке } a$$

$$\bullet \ I'(a) = \int_X f'_y(x, a) d\mu(x)$$

Доказательство:

$$F(x, h) = \frac{f(x, a+h) - f(x, a)}{h} \rightarrow f'_y(x, a)$$

$$\frac{I(a+h) - I(a)}{h} = \int_X F(x, h) d\mu(x) \xrightarrow{?} \int_X f'_y(x, a) d\mu$$

чтобы использовать предельный переход нужно проверить $F(x, h) \in L_{loc}$ в точке $h = 0$, т. е. найти локальную мажоранту. (см. теор. о пред. переход. под интегралом)

$$|F(x, h)| \underset{\text{т. Лагранжа}}{=} |f'_y(x, a + \theta h)| \underset{f'_y \in L_{loc} \text{ in } a}{\leq} g(x)$$

52 Теорема о свойствах аппроксимативной единицы

$$1. \ f \in \tilde{C}[-\pi, \pi] \Rightarrow (f * K_h) \underset{h \rightarrow h_0}{\Rightarrow} f, \text{ где свертка } (f * K)(x) = \int_{-\pi}^{\pi} f(x - t) K(t) dt$$

$$2. \ f \in L^1[-\pi, \pi] \Rightarrow \|(f * K_h) - f\|_1 \underset{h \rightarrow h_0}{\rightarrow} 0$$

3. K_h - усил. апрокс ед. f - непр. в точке x . Тогда $(f * K_h)(x) \rightarrow f(x)$
Замеч.) пункт 2 верен для L_p

Доказательство:

$$1. (f * K)(x) - f(x) = \int_{-\pi}^{\pi} (f(x-t) - f(x)) K_h(t) dt = \int_{E_\delta} + \int_{(-\delta, \delta)} = I_1 + I_2$$

компакте $[-\pi, \pi] \leq \int_{-\pi}^{\pi} |(f(x-t) - f(x)) K_h(t)| dt = \int_{E_\delta} + \int_{(-\delta, \delta)} = I_1 + I_2$

Заметим, что $I_1 \leq 2 \|f\|_\infty \int_{E_\delta} |K_h| < \frac{\epsilon}{2}$, т.к. f - огр, и по 3 а.е. интеграл стремится к 0

Заметим, что $I_2 \leq \frac{\epsilon}{2M} \int_{(-\delta, \delta)} |K_h| dt < \frac{\epsilon}{2}$, т.к. по непрерывности : $\forall \epsilon > 0 \exists \delta : |f(x) - f(x - \delta)| < \epsilon' = \frac{\epsilon}{2M}$

$$2. \|(f * K_h(x)) - f\|_1 = \int_{-\pi}^{\pi} \left| \int_{-\pi}^{\pi} f(x-t) - f(x) K_h(t) dt \right| dx \leq \int_{-\pi}^{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} |f(x-t) - f(x)| |K_h(t)| dt dx = \|K_h\|_1 \int_{-\pi}^{\pi} g(-t) \frac{K(t)}{\|K_h\|_1} dt, \text{ где } g(t) = \int_{-\pi}^{\pi} |f(x-t) - f(x)| dx$$

$\frac{|K_h|}{\|K_h\|} - \text{а.е.} \Rightarrow \int_{-\pi}^{\pi} g(-t) \frac{|K|}{\|K_h\|} dt \xrightarrow{h \rightarrow h_0} g(0) = 0$. Замечание: последний предельный переход верен из свойства (1) выше, т.к. $K * g \Rightarrow g$, а $K * g = \int_{-\pi}^{\pi} g(x-t) K(t) dt$ для любого x , в нашем случае в интеграле $g(-t)$, то есть взято $x = 0$

$$3. (f * K_h)(x) - f(x) = \int_{-\pi}^{\pi} (f(x-t) - f(x)) K_h(t) dt = I_1 + I_2 \text{ (как в пункте 1.)}$$

$I_2 \leq 2\delta\epsilon \text{ esssup}(K_h)$, т.к. f - непр и поэтому на $(-\delta, \delta)$ интеграл от $f(x-t) - f(x) 2\delta\epsilon$

$$I_1 \leq (2\pi|f(x)| + \|f\|_1) \operatorname{esssup}_{E_\delta}(K_h), \text{ т.к. } \int_{E_\delta} f(x)K_h(t) \leq \operatorname{esssup}_{E_\delta}(K_h) \cdot 2\pi|f(x)| \rightarrow 0 \text{ (т.к. } \operatorname{esssup} \rightarrow 0 \text{). Аналогично } \int_{E_\delta} f(x-t)K_h(t) \leq 2\pi\|f(x)\|_1 \operatorname{esssup}_{E_\delta}(K_h) \rightarrow 0.$$

Все доказано!

53 Теорема Фейера.

1. $f \in \tilde{C}[\pi, -\pi]$, тогда $\sigma_n \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} f$
2. $f \in L_p[\pi, -\pi], (1 \leq p < +\infty)$, тогда $\|\sigma_n(f) - f\|_p \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0$
3. $f \in L_1[\pi, -\pi], f$ - непр. в т. x , тогда $\sigma_n(f, x) \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} f(x)$

Доказательство:

1. ядра Фейера – аппрок. единица

- $\int_{-\pi}^{\pi} \Phi_n = 1$ – по Лемме о простых свойствах ядра Фейера
- $\Phi_n > 0 \Rightarrow \int_{-\pi}^{\pi} |\Phi_n| \leq 1$
- $t \in E_\delta \quad |\Phi_n(t)| = \frac{1}{(n+1)2\pi} \frac{\sin^2 \frac{n+1}{2}t}{\sin^2(t/2)} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0$

Далее по теореме о свойствах аппрок. ед-цы следуют все 3 пункта.

54 Свойства преобразования Фурье: непрерывность, ограниченность, сдвиг. TODO

55 Преобразование Фурье свертки.

$$f, g \in L_1(R^m)$$

Тогда:

$$1. \widehat{f * g} = \widehat{f}(y)\widehat{g}(y)dy$$

$$2. \int_{\mathbb{R}^m} \widehat{f}(y)g(y)dy = \int_{\mathbb{R}^m} f(y)\widehat{g}(y)dy$$

Доказательство:

$$1. \widehat{f * g}(y) = \int_{\mathbb{R}^m} \left(\int_{\mathbb{R}^m} f(t)g(x-t)dt \right) e^{-2\pi i \langle x, y \rangle} dx = \int_{\mathbb{R}^m} f(t) e^{-2\pi i \langle t, y \rangle} \left(\int_{\mathbb{R}^m} g(x-t) e^{-2\pi i \langle x-t, y \rangle} dx \right) dt = \int_{\mathbb{R}^m} f(t) e^{-2\pi i \langle t, y \rangle} \widehat{g}(y) dt = \widehat{f}(y) \cdot \widehat{g}(y)$$

$$2. \text{ л. ч. } = \int_{\mathbb{R}^m} \int_{\mathbb{R}^m} f(x) e^{-2\pi i \langle y, x \rangle} dx g(y) dy = \int_{\mathbb{R}^m} f(x) \int_{\mathbb{R}^m} g(y) e^{-2\pi i \langle x, y \rangle} dy dx = \int_{\mathbb{R}^m} f(x) \widehat{g}(x) dx$$

56 Преобразование Фурье и дифференцирование

$$f \in L^1(\mathbb{R}^m)$$

$$1. k — номер координаты, $\frac{df}{dx_k} \in L^1$, а также непрерывно $\widehat{\left(\frac{df}{dx_k}\right)}(y) = 2\pi i y_k \widehat{f}(y)$$$

$$2. |x|f(x) — сумм. Тогда $\widehat{f} \in C^1(\mathbb{R}^m)$, $\forall c : \frac{d\widehat{f}}{dy_k}(y) = -2\pi i (x_k \widehat{f}(x))$ (пр. Лейбница)$$

Доказательство:

56.1 Обозначения

Пусть $k = m$.

Рассмотрим $g = \frac{df}{dx_k}$, а также $(x_1, \dots, x_{m-1}, x_m) = (u, t)$,

где $u = (x_1, \dots, x_{m-1})$, $t = x_m$. Тогда $\frac{df}{dx_k} = \frac{df}{dt}(u, t) = g(u, t)$.

56.2 Утверждение: при п.в. u : $f(u, t) \rightarrow 0$ ($t \rightarrow \infty$)

Это утверждение почти очевидно: $\int_0^t g(u, \tau) d\tau = f(u, t) - f(u, 0)$,
 g — сумм. в \mathbb{R}^m , тогда отображение $t \mapsto g(u, t)$ — сумм. п.в. u на \mathbb{R}
 (это утверждает Теорема Фубини), т.е. $\int_0^t g(u, \tau) d\tau \xrightarrow{t \rightarrow +\infty} \int_0^{+\infty} g(u, \tau) d\tau$ (при п.в. u)

Аналогично: f — сумм в \mathbb{R}^m , тогда $t \mapsto f(u, t)$ — сумм в \mathbb{R} . То есть при п.в. u есть одновременно и предел $f(u, t \rightarrow \infty)$ и $f(u, t)$ суммируема на \mathbb{R} , тогда очевидно этот предел $f(u, t \rightarrow \infty) = 0$

56.3 Доказательство основного факта теоремы:

Докажем только пункт (1), а пункт (2) разбирается как-то так же + кукарек про пр. Лейбница

Найдем \hat{g} (с помощью инт. по частям и сведения к \hat{f}).

$$\begin{aligned} & \int_{-\infty}^{+\infty} g(u, t) e^{-2\pi i y_m t} dt \stackrel{\text{т.к. } g=f'_t}{=} f(u, t) e^{-2\pi i y_m t} \Big|_{t=-\infty}^{t=+\infty} - \\ & - \int_{-\infty}^{+\infty} f(u, t) (-2\pi i y_m) e^{-2\pi i y_m t} dt = (2\pi i y_m) \int_{-\infty}^{+\infty} f(u, t) e^{-2\pi i y_m t} dt \quad (\text{при п.в. } u). \end{aligned}$$

Но на самом деле мы считаем интегралы по \mathbb{R}^m !!! Поэтому мы только что показали следующее:

$$\begin{aligned} & \int_{\mathbb{R}^{m-1}} \int_{-\infty}^{+\infty} g(u, t) e^{-2\pi i y_m t} e^{-2\pi i (u_1 y_1 + \dots + u_{m-1} y_{m-1})} dt = \\ & = \int_{\mathbb{R}^{m-1}} \int_{-\infty}^{+\infty} (2\pi i y_m) f(u, t) e^{-2\pi i \langle (u, t), y \rangle} dt dy = (2\pi i y_m) \hat{f}(y), \quad \text{ч.т.д.} \end{aligned}$$

57 Лемма об оценке интеграла ядра Дирихле

1. $D_n(t) = \frac{\sin nt}{\pi t} + \frac{1}{2\pi} (\cos nt + h(t) \sin nt)$, где $h(t)$ не зависит от n и $|h(t)| \leq 1$ на $[-\pi; \pi]$.
2. $\forall x, |x| < 2\pi \quad \left| \int_0^x D_n(t) dt \right| < 2$

Доказательство:

1. (a) $D_n(t) = \frac{1}{2\pi} \frac{\sin(n+\frac{1}{2})t}{\sin \frac{t}{2}} = \frac{1}{2\pi} \frac{\sin nt \cos \frac{t}{2} + \cos nt \sin \frac{t}{2}}{\sin \frac{t}{2}} = \frac{1}{2\pi} \left(\frac{\sin nt}{\operatorname{tg} \frac{t}{2}} + \cos nt \right)$

(b) Добавим и вычтем $\frac{\sin nt}{\pi t}$:

$$\frac{\sin nt}{\pi t} + \frac{1}{2\pi} \left(\cos nt + \underbrace{\left(\frac{1}{\operatorname{tg} \frac{t}{2}} - \frac{1}{t} \right)}_{h(t)} \sin nt \right)$$

(c) Докажем, что $|h(t)| \leq 1$. Найдём знак производной на $[0; \pi]$:

$$h'(t) = -\frac{1}{2\sin^2 \frac{t}{2}} + \frac{2}{t^2} = \frac{4\sin^2 \frac{t}{2} - t^2}{2t^2 \sin^2 \frac{t}{2}}. \text{ Знаменатель неотрицателен.}$$

$4\sin^2 \frac{t}{2} - t^2 = (2\sin \frac{t}{2} - t)(2\sin \frac{t}{2} + t)$. Вторая скобка ≥ 0 . Первая скобка ≤ 0 , так как $\sin x \leq x$ при $x \geq 0$.

(d) Знак производной $h(x)$ на $[0; \pi]$ постоянен, значит, h монотонна. $h(0) = 0$ (в пределе), $h(\pi) = \frac{2}{\pi} < 1$.

Значит, $|h(x)| < 1$. Аналогично для $[-\pi; 0]$.

2. (a) D_n — чётная. Считаем, что $x > 0$.

(b) Пусть $x \in [0; \pi]$.

(c) $\left| \int_0^x D_n(t) dt - \int_0^x \frac{\sin nt}{\pi t} dt \right| = \left| \int_0^x \frac{1}{2\pi} (\cos nt + h(t) \sin nt) dt \right|$ (пункт 1)
 $\leq \frac{1}{2\pi} \int_0^x 2 dt = \frac{x}{\pi} \leq 1$

(d) $\int_0^x \frac{\sin nt}{\pi t} dt = \int_0^{nx} \frac{\sin v}{\pi v} dv$ ($v = nt$).
 $0 \leq \int_0^{nx} \frac{\sin v}{\pi v} dv \leq \int_0^\pi \frac{\sin v}{\pi v} dv$. Доказательство методом пристального взгляда на график подынтегральной функции.

$$\int_0^\pi \frac{\sin v}{\pi v} dv \leq \pi \frac{1}{\pi} = 1$$

(e) $\left| \int_0^x D_n(t) dt - I \right| \leq 1$, $0 \leq I \leq 1$, значит, $\int_0^x D_n(t) dt \in [-1; 2]$.

(f) Пусть $x \in [\pi; 2\pi]$. $\int_0^{2\pi} D_n(t) dt = 1$.

$\int_0^x = \int_0^{2\pi} - \int_x^{2\pi} = 1 - \int_{x-2\pi}^0 = 1 - \int_0^{2\pi-x} \in [-2; 1]$ **Какая-то странная перестановка пределов интегрирования, надо бы ещё пояснить**

58 Теорема об интегрировании ряда Фурье

$$f \in L_1[-\pi; \pi].$$

Тогда $\forall a, b \in \mathbb{R}$:

$$\int_a^b f(x)dx = \sum_{k \in \mathbb{Z}} c_k(f) \int_a^b e^{ikx} dx$$

Сумма по $k \in \mathbb{Z}$ понимается в смысле главного значения $(\lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{k=-n}^n)$.

Замечание: Ряд Фурье f может всюду расходиться, но ряд интеграла всегда сходится.

Доказательство:

1. Пусть $-\pi \leq a < b \leq \pi$. Если это не так всегда можно разбить интеграл на такие отрезки в силу периодичности функции.
2. Пусть $\chi(x) = \chi[a; b]$ (характеристическая функция отрезка $[a; b]$).
3. Рассмотрим частичную сумму ряда интегралов:

$$\sum_{k=-N}^N c_k(f) \underbrace{\int_a^b e^{ikx} dx}_{2\pi c_{-k}(\chi)} = \sum_{k=-N}^N \frac{1}{2\pi} \left(\int_{-\pi}^{\pi} f(t) e^{-ikt} dt \right) 2\pi c_{-k}(\chi).$$

Сумма конечная, поэтому это равно $\int_{-\pi}^{\pi} f(t) S_N(\chi, t) dt$.

4. $S_N(\chi) \rightarrow \chi$ везде, кроме a и b (не шарю почему, помогите)
5. $|S_N(\chi, t)| = \left| \int_{-\pi}^{\pi} \chi(x) D_N(t-x) dx \right| = \left| \int_a^b D_N(t-x) dx \right| = \left| \int_0^{t-a} D_N - \int_0^{t-b} D_N \right| \leq 4$ (по лемме об оценке интеграла D_N).
6. $\int_{-\pi}^{\pi} f(t) S_N(\chi, t) dt \rightarrow \int_{-\pi}^{\pi} f(t) \chi(t) dt$ по теореме Лебега о мажорированной сходимости.

59 Лемма о сходимости сумм Фурье в смысле обобщенных функций

$$f \in L_1[-\pi; \pi]$$

Что это за обозначение?

Тогда $\forall u \in \widetilde{\mathbb{C}}^\infty$

$$\int_{-\pi}^{\pi} S_n(f, x)u(x)dx \rightarrow \int_{-\pi}^{\pi} f(x)u(x)dx$$

Доказательство: // TODO - нужно больше пояснений

1. $f * u$ - непр. и гладкая (т.к. $u \in L_\infty[-\pi, \pi]$)

$$((f * u)(x))' = \left(\int_{-\pi}^{\pi} f(t)u(x-t)dt \right)'_x = \int_{-\pi}^{\pi} f(t)u'(x-t)dt$$

$$\frac{d}{dt} \left(\int_X f(x, t) d\nu(x) \right) = \int_X f'_x(x, t) d\nu(x)$$

$$L_{loc}(t_0) : \quad \exists u(t_0) : |f'_t(x, t)| \leq g(x), g(x) - \text{сумм. при } x \in X, t \in u(t_0) \\ |f(t)u'(x-t)| \leq \max |u'(y)| \cdot |f(t)|, y \in [-\pi, \pi]$$

2. $\underline{u}(x) := u(-x)$

$$\int_{-\pi}^{\pi} e^{ikx} u(x) dx = \int_{-\pi}^{\pi} e^{-ikx} u(-x) dx = 2\pi c_k(\underline{u})$$

$$\text{Так как сумма конечная, } \int_{-\pi}^{\pi} S_n(f, x)u(x)dx = \sum_{k=-n}^n (c_k(f) \int_{-\pi}^{\pi} e^{ikx} u(x)dx) =$$

$$2\pi \sum_{k=-n}^n c_k(f)c_k(\underline{u}) = \sum_{k=-n}^n (f * \underline{u})e^{ikx} \Big|_{x=0} \rightarrow (f' * \underline{u})(0) = \int_{-\pi}^{\pi} f(t)\underline{u}(0-t)dt = \int_{-\pi}^{\pi} f(t)u(t)dt$$

Определение: f – обобщенная функция, если задан непрерывный функционал $\mathbb{C}^\infty \rightarrow \mathbb{R}$.

Определение: f, f_n – последовательность обобщенных функций: $f_n \rightarrow f$,

если $\forall u \in \mathbb{C}^\infty \quad \int_{-\pi}^{\pi} f_n u \rightarrow \int_{-\pi}^{\pi} f u$.

60 Следствие о преобразовании Фурье финитных функций

(Следствие из теоремы “56. Преобразование Фурье и дифференцирование“.)

1. $f \in L_1(\mathbb{R}^m)$ – финитная ($= 0$ вне некоторой окрестности).

Тогда $\widehat{f} \in \mathbb{C}^\infty(\mathbb{R}^m)$

Что это за обозначение?

2. $f \in \mathbb{C}_0^\infty(\mathbb{R}^m)$

Тогда $\forall p > 0 \quad |y|^p \widehat{f}(y) - \text{сумм.}$

Доказательство:

1. Из финитности следует $\forall p \quad |x|^p f(x) - \text{сумм.}$

$$\frac{\partial \widehat{f}}{\partial y} = -2\pi i \widehat{(x_k f)}$$

$$\frac{\partial^2 \widehat{f}}{\partial y_k \partial y_l} = -2\pi i \frac{\partial}{\partial y_l} \widehat{(x_k f)} = -2\pi i (-2\pi i) \widehat{(x_l x_k f)}$$

2. из п.1 теоремы (56) следует:

$$(a) \quad \widehat{\left(\frac{\partial f}{\partial x_k}\right)} = 2\pi i y_k \widehat{f}(y)$$

- (b) $\forall \alpha$ – мультииндексы:

$$\widehat{\left(\frac{\partial^{|\alpha|} f}{\partial x^\alpha}\right)} = (2\pi i)^{|\alpha|} y^\alpha \widehat{f}(y)$$

$$\widehat{\left(\frac{\partial}{\partial x_l} \cdot \frac{\partial f}{\partial x_k}\right)} = 2\pi i y_l \frac{\partial \widehat{f}}{\partial x_k}(y) // \text{ TODO - тут вроде надо будет пояснить,}$$

почему левая часть ограничена

61 Лемма "о ядре Дирихле".

Если:

1. $f \in L^1(\mathbb{R})$

2. $x \in \mathbb{R}$

Тогда: $\forall A > 0 \quad I_A(f, x) = \int_{-A}^A \hat{f}(y) e^{2\pi i xy} dy = \int_{-\infty}^{\infty} f(x-t) \frac{\sin(2\pi At)}{\pi t} dt.$

Доказательство:

$$\chi_A := \chi_{[-A; A]}$$

$$I_A(f, x) = \int_{\mathbb{R}} \hat{f}(y) (\chi_A(y) e^{2\pi i xy}) dy = \int_{\mathbb{R}} f(y) (\widehat{\chi_A e^{2\pi i xy}}) dy = \int_{\mathbb{R}} f(y) \widehat{\chi_A}(y-x) dy = \int_{\mathbb{R}} f(y) \frac{\sin 2\pi A(y-x)}{\pi(y-x)} dy$$

Следствие: $f \in L^1(\mathbb{R})$, $x \in \mathbb{R}$, $A > 0$

Тогда $\forall \delta > 0 \quad I_A(f, x) = \int_{-\delta}^{\delta} f(x-t) \frac{\sin 2\pi At}{\pi t} dt + o(1), A \rightarrow \infty$

Доказательство:

$\int_{|t|>\delta} f(x-t) \frac{\sin 2\pi At}{\pi t} dt \rightarrow 0$ по теореме Римана-Лебега $\frac{f(x-t)}{\pi t}$ - сумм в $\{t : |t| > \delta\}$

$$\left| \frac{f(x-t)}{\pi t} \right| \leq \frac{1}{\pi \delta} |f(x-t)|$$

Замечание: $D_n(t) = \frac{\sin t}{t} + \frac{1}{2\pi} (\cos(nt) + h(t) \sin(nt))$

62 Теорема о равносходимости ряда Фурье и интеграла Фурье

Если:

1. $f \in L^1(R)$
2. $f_0 \in L^1[-\pi; \pi]$
3. $f = f_0$ в $U(x)$, где $x \in R$

Тогда в точке x : сходимость интеграла Фурье \Leftrightarrow сходимость ряда Фурье и в случае сходимости $\int_{-\infty}^{\infty} \hat{f}(y) e^{2\pi i xy} dy = \sum_{n=-\infty}^{\infty} c_n(f_0) e^{i\pi x}$

Доказательство:

Проверим: $I_A(f, x) - S_{[2\pi A]}(f, x) \rightarrow 0, A \rightarrow \infty$

$$1. \quad I_A(f, x) = \int_{-\delta}^{\delta} f(x-t) \frac{\sin(2\pi At)}{\pi t} dt + o(1), A \rightarrow \infty$$

$$2. \quad S_n(f, x) = \int_{-\delta}^{\delta} f(x-t) \frac{\sin(nt)}{\pi t} dt$$

$2\pi A = n$ - целое, тогда проверять и ничего $2\pi A$ - нецелое. $n = [2\pi A]$

$|I_A(f, x) - I_{\frac{n}{2\pi}}(f, x)| = \left| \int_{-A}^A - \int_{-\frac{\pi}{2n}}^{\frac{\pi}{2n}} \right| \leq \int_{A-\frac{1}{2\pi}}^A + \int_{-A}^{-A+\frac{1}{2\pi}} \leq 2 * \frac{1}{2\pi} \max_{|y|>A-\frac{1}{2\pi}} |\hat{f}(y)| \rightarrow 0$, как суммируемая функция.

63 Признак Дирихле–Жордана

Если:

$$f \in L^1(\mathbb{R}) \text{ или } f \in L^1[-\pi, \pi]$$

$x \in \mathbb{R}$, в окрестности x f имеет ограниченную вариацию.

Тогда:

$$S_n(f, x) \rightarrow_{n \rightarrow \infty} 1/2 * (f(x+0) + f(x-0))$$

А также $I_A(f, x)$ стремится к этому при стремлении A к бесконечности

Доказательство:

$$S_n(f, x) = \int_{-\delta}^{\delta} f(x-t) * \frac{\sin(nt)}{\pi t} dt + o(1) = \int_0^{\delta} \phi(t) \frac{\sin(nt)}{\pi t} dt + o(1), \text{ где } \phi(t) = f(x-t) + f(x+t)$$

Пусть δ меньше радиуса из условия. Пусть Φ - убывающая положительная функция и $\Phi(t) = \phi(t) * \chi_{[0, \delta]}(t)$

Так как ϕ - ограниченная вариация, то она представима как разность двух убывающих функций, а из этого у нас существует $\phi(t+0)$ для любого t (глобальный признак сходимости). */ * у меня это указано в качестве замечаний * /*

$$\int_0^{\delta} \Phi(t) \frac{\sin(nt)}{\pi t} dt = \int_0^{\infty} \Phi(t) \frac{\sin(nt)}{\pi t} dt = \int_0^{\infty} \Phi(u/n) \frac{\sin(u)}{\pi u} du \rightarrow$$

$$\text{magic - knowledge} \rightarrow \phi(0+) \int_0^{\infty} \frac{\sin(u)}{\pi u} du = 1/2 * \phi(0+)$$

64 Лемма к теореме о формуле обращения.

1. w_t - а.е. при $t \rightarrow 0$

$$2. w_t(x) = \int_{\mathbb{R}^m} e^{-\pi t^2 |y|^2} e^{-2\pi \langle x, y \rangle} dy, \text{ т.е. } w_t = (\hat{V}_t), \text{ где } V_t(x) = e^{-\pi t^2 |x|^2}$$

Доказательство:

1. $w_t \geq 0$

$$2. \int_{\mathbb{R}^m} w_t(x) dx = \frac{1}{t^m} \int_{-\infty}^{+\infty} dx_1 \int_{-\infty}^{+\infty} dx_2 \cdots \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-\frac{\pi}{t^2} \sum (x_i)^2} dx_m = \prod_{k=1}^m \frac{1}{t} \int_{-\infty}^{+\infty} e^{-\frac{\pi x_k^2}{t^2}}$$

1, т.к. это интеграл Эйлера-Пуассона с заменой $x := \sqrt{\pi} x/t$

3. $\int_{|x|>\delta} w_t \leq e^{\frac{-\delta^2\pi}{2t^2}} \frac{1}{t^m} \int_{|x|>\delta} e^{\frac{-\pi|x|^2}{2t^2}} \leq e^{\frac{-\delta^2\pi}{2t^2}} \frac{1}{t^m} \int_{R^m} e^{\frac{-\pi|x|^2}{2t^2}} .$ Экспонента $\rightarrow 0$, а интеграл ограничен. Значит $\int_{|x|>\delta} w_t \rightarrow 0$

$f_a(x) = e^{-\pi a^2 x^2}, x \in R, a > 0, (\hat{f}_a) = \frac{1}{a} f_{\frac{1}{a}}$ (ребята TODOOOO не шарю к чему это тут ????)

$\int_{R^m} e^{-\pi t^2 |y|^2} e^{-2\pi i \langle x, y \rangle} dy = \prod_{k=0}^{m-1} \int_R e^{-\pi t^2 y_k^2} e^{-2\pi i \langle x_k, y_k \rangle} dy_k = \prod_{k=0}^{m-1} \frac{1}{t} e^{\frac{-\pi x_k^2}{t^2}} = \frac{1}{t^m} e^{\frac{-\pi |x|^2}{t^2}}$ (и это вообще тут зачем, помогите плиз. Казалось бы это должно доказывать что $w_t * f \rightarrow f$, но я тут этого не вижу явно...)

65 Формула обращения преобразования Фурье.

$f \in L^1(R^m)$ Если $\hat{f} \in L^1(R^m)$, то при п.в. x $f(x) = \int_{R^m} \hat{f}(y) e^{2\pi i \langle x, y \rangle} dy$

Замечания:

1) П.Ч.: подынт.ф. непр. по x

есть сумм. мажоранта: $|\hat{f}(y)| \Rightarrow$ П.Ч. — непрерывна по x

2) ПЧ. непр по x и при этом ф-ла вып. п.в. \Rightarrow ф-ла верна в точке непр-сти f

Итого: Если $f \in C(R^m), f \in L^1(R^m), \hat{f} \in L^1(R^m)$, то ф-ла обращения вып. при всех x . Доказательство: Пусть $w_t(x) = \frac{1}{t^m} e^{\frac{-\pi|x|^2}{t^2}}, x \in R^m$ ($t > 0$)

$$\begin{aligned} f * w_t(x) &= \int_{R^m} f(y) w_t(x - y) dy = \int_{R^m} f(y) w_t(y - x) dy \quad (w_t - \text{четная}) \\ &= \int_{R^m} f(y + x) w_t(y) dy = \int_{R^m} f(x + y) (\hat{V}_t) dy = \int_{R^m} (f(y + x)) V_t(y) dy = \\ &= \int_{R^m} e^{2\pi i \langle x, y \rangle} \hat{f}(y) V_t(y) dy \end{aligned}$$

$$\text{Итак : } f * w_t(x) = \int_{R^m} e^{-\pi t^2 |y|^2} e^{2\pi i \langle x, y \rangle} \hat{f}(y) dy = I$$

(замечание: т.к. w_t четное, то в интеграле, равном w_t мы можем менять знак перед x и он останется тем же. этим мы и пользовались)

$e^{-\pi t^2 |y|^2} e^{2\pi i \langle x, y \rangle} \hat{f}(y) \rightarrow e^{2\pi i \langle x, y \rangle} \hat{f}(y)$ при $t \rightarrow 0$. И есть сумм. мажоранта $|\hat{f}(y)|$. Значит интеграл I стремится к $\int_{R^m} e^{2\pi i \langle x, y \rangle} \hat{f}(y) dy$

Берем $t_n \rightarrow 0$

$$f * w_t \rightarrow f \text{ в } L^1 \Rightarrow$$

$$f * w_{t_n} \Rightarrow f \text{ (по мере)}$$

$\Rightarrow \exists n_k : f * w_{t_{n_k}} \rightarrow f$ п.в. (т. Рисса)

Поэтому $f(x) = \lim_{t_{n_k} \rightarrow 0} f * f * w_{t_{n_k}} = \int \cdots \rightarrow \int_{R^m} e^{2\pi i \langle x, y \rangle} \hat{f}(y)$, что и требовалось доказать.

66 Свойства свертки. Deprecated

1. Коммутативность: $f * K = K * f$

2. $c_k(f * K) = 2\pi c_k(f)c_k(K)$ (c_k – коэф. ряда Фурье)

3. $f \in L^p$; $K \in L_1([-\pi, \pi])$

$$1 \leq p \leq +\infty$$

Тогда:

- $f * K \in L([-\pi, \pi])$
- $\|f * K\|_p \leq \|K\|_1 \|f\|_p$

Доказательство: TODO

67 О локальной суммируемости. Deprecated

$$\int_a^{\rightarrow b} f - \text{абс. сж} \iff f - \text{сумм.}$$

Доказательство: TODO