

# Теоремы по матану, семестр 4

11 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

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

24 Теорема (принцип Кавальери)	33
25 Теорема Тонелли	35
26 Формула для Бета-функции	37
27 Объем шара в $\mathbb{R}^m$	37
28 Теорема о вложении пространств $L^p$	37
29 Теорема о сходимости в $L_p$ и по мере	38
30 Полнота $L^p$	39
31 Лемма Урысона	40
32 Плотность в $L^p$ непрерывных финитных функций	40
33 Теорема о непрерывности сдвига	41
34 Теорема об интеграле с функцией распределения	42
35 Теорема о свойствах сходимости в гильбертовом пространстве	42
36 Теорема о коэффициентах разложения по ортогональной системе	43
37 Теорема о свойствах частичных сумм ряда Фурье. Неравенство Бесселя	44
38 Теорема Рисса – Фишера о сумме ряда Фурье. Равенство Парсеваля	45
39 Теорема о характеристике базиса	45
39.1 $1 \Rightarrow 2$ . . . . .	46
39.2 $2 \Rightarrow 3$ . . . . .	46
39.3 $3 \Rightarrow 4$ . . . . .	46

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

54	Свойства преобразования Фурье: непрерывность, ограниченность, сдвиг. TODO	57
55	Преобразование Фурье свертки. TODO	57
56	Преобразование Фурье и дифференцирование. TODO	57
57	Лемма об оценке интеграла ядра Дирихле	57
58	Теорема об интегрировании ряда Фурье	58
59	Лемма о сходимости сумм Фурье в смысле обобщенных функций. TODO	60
60	Следствие о преобразовании Фурье финитных функций. TODO	60
61	Лемма "о ядре Дирихле". Следствие. TODO	60
62	Теорема о равносходимости ряда Фурье и интеграла Фурье. TODO	60
63	Признак Дирихле–Жордана. TODO	60
64	Лемма к теореме о формуле обращения. TODO	60
65	Формула обращения преобразования Фурье. TODO	60
66	Свойства свертки. Deprecated	60
67	О локальной суммируемости. Deprecated	61

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

$(X, \mathbb{A}, \mu)$  — 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

$(X, \mathbb{A}, \mu)$  - 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  $\phi$ :



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

$X(|f_n - f| \geq \epsilon) \subset X(\phi_n \geq \epsilon) \Rightarrow$  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

$(X, \mathbb{A}, \mu)$  - 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)

$(X, \mathbb{A}, \mu)$  — 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.  $\mu, \nu$  -  $\sigma$ -конечны  $\Rightarrow m_0$  -  $\sigma$ -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 дизъюнктивности  $P_k$  (( $x, y$ ) 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  $\mu$  по  $x$ , затем по мере  $\nu$  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  $\epsilon$  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:

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

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

$A := \text{supp } g_n$  ( $\text{supp } f := \text{замыкание } \{x \mid f(x) \neq 0\}$ ) Слово «замыкание» выглядит лишним

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

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

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

Теперь докажем основное утверждение:

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

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

## 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:

$$\bullet \int_X \underline{\lim}(f_n) \geq \underline{\lim} \int_X f_n$$

Доказательство:

$$\exists n_k \mid \int_X f_{n_k} \xrightarrow{k \rightarrow +\infty} \underline{\lim}_{n \rightarrow +\infty} \int_X f_n$$

Рассмотрим  $g_{n_k}$  такое, что  $g_{n_k} \uparrow$  и  $g_{n_k} \rightarrow \underline{\lim} f$

Применяем теорему Леви к нер-ву  $\int_X g_{n_k} \leq \int_X f_{n_k}$

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

Выглядит как какой-то бред, откуда вообще взялась  $g$  и оценка на неё?



# 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  $\Phi^{-1}(\mathbb{B}) \subset \mathbb{A}$  (Кохась сказал, что это легко, и вроде это следует из предыдущих теорем) эта запись про Кохася тут вообще к чему?

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

Тогда:

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

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  $\nu$ ), то  $f \circ \Phi$  измерима относительно  $\mu$ .

Раньше тут какая-то лажа была написана

## 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,  $\nu$  — взвешенный образ  $\mu$  ( $w$  — плотность)

Тогда:

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

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

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  $\Rightarrow f = \sum \alpha_k * \chi_{E_k}$   

$$- \int_Y \sum \alpha_k * \chi_{E_k} d\mu = \sum \alpha_k \chi_{E_k} d\nu = /*firstcase*/ = \sum \alpha_k \int_X \chi_{E_k}(\Phi(x)) * \omega(x) dx = \int_X \sum \alpha_k \chi_{E_k}(\Phi(x)) * \omega(x) d\mu(x) = \int f \circ \Phi * \omega d\mu$$

А дальше что?

## 16 Критерий плотности

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

$\nu$  — еще одна мера.

$\omega \geq 0$  — измерима на  $X$ .

Тогда:

$\omega$  — плотность  $\nu$  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
- $\Leftarrow$

Что за бред тут вообще написан?

- Достаточно доказать, что  $\omega > 0$  (когда  $\omega = 0$ , отсюда следует что интеграл  $= 0$  из оценок, что  $\nu(E) = 0$ )
- Давайте брать такие  $A \subset X(\omega > 0)$ , тогда  $\nu A = \int_A \omega(x) d\mu$
- Тогда для любого  $A \in \mathbb{A}$   $A = A_1 \sqcup A_2$ , где  $A_1 \subset A(\omega > 0)$  &  $A_2 \subset A(\omega = 0)$
- Получаем, что  $\nu A = \nu A_1 + \nu A_2 = \int_{A_1} \omega + 0 = \int_{A_1} \omega + \int_{A_2} \omega = \int_A \omega$

- Пусть  $q \in (0, 1)$  и  $A_j := A(q^j \leq \omega(x) < q^{j-1}), j \in Z$ . Получается, что  $A = \bigsqcup_{j \in Z} A_j$
- Рассмотрим  $q^j \mu A_j \leq \nu A_j \leq q^{j-1} * \mu A_j$  и  $\nu A_j = \int_{A_j} \omega d\mu$
- $q * \int_A \omega d\mu = q * \sum \int_{A_j} \leq \sum q^j * \mu A_j \leq \sum j * A_j = \nu(A) \leq 1/q * \sum q^j * \mu A_j \leq 1/q * \sum \int_{A_j} \omega = 1/q * \int_A \omega$
- $q * \int_A \omega d\mu \leq \nu(A) \leq 1/q * \int_A \omega d\mu$
- Устремим  $q$  к 1 и мы победили

## 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  $\nu$  относительно  $\mu$  определена однозначно с точностью до  $\mu$ -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.

## 18 Лемма о множестве положительности

Пусть есть пространство  $\langle X, \mathbb{A} \rangle$  и  $\phi$  — 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  $\epsilon$ -положительности (М $\epsilon$ П), если  $\forall C \subset E, C$  измеримо:  $\phi(C) \geq -\epsilon$
- **Утверждение:**  $\forall \epsilon > 0$   $A$  содержит М $\epsilon$ П  $C$ , такое что  $\phi(C) \geq \phi(A)$ .
  1. Если  $A$  — М $\epsilon$ П, то  $C = A$
  2. Пусть  $A$  — не М $\epsilon$ 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 $\epsilon$ 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 $\epsilon$ П для любого  $\epsilon$ , 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  $(X, \mathbb{A}, \mu)$ .

$\nu$  — 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  $\nu$  относительно  $\mu$  и при этом  $f$  суммируема по  $\mu$ .

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

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

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

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

$\exists$  последовательность  $f_1 \leq f_2 \leq \dots \in P : \int_X f_n d\mu \rightarrow I$

4. Рассмотрим  $p_1, p_2, \dots : \int_X p_n \rightarrow I$ , 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

$$\int_X f = \lim \int_X f_n = I \leq \nu(X)$$

6. Отлично, проверим, что  $f$  — плотность  $\nu$  относительно  $\mu$ .

(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  $\nu$  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)

- (е)  $\phi(E_0) > 0$  (пункт с). Возьмем МП  $B \subset E_0 : \phi(B) \geq \phi(E_0) > 0$ .  
Тогда  $\nu(B) = \phi(B) + \int_B f \cdot d\mu + a \cdot \mu B \geq \phi(B) > 0$
- (ф) Проверим, что  $f + a \cdot \chi_B \in P$ . По определению:  $\int_E (f + a \cdot \chi_B) d\mu =$   

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

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

## 20 Лемма об оценке мер образов кубов из окрестности точки дифференцируемости

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

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

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

$L := \Phi'(a), L$  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  $(1 + 2\epsilon)h$

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

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

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

## 21 Лемма «Вариации на тему регулярности меры Лебега»

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

$A \subset O$ ,  $A$  - открыто.

$A \subset Q$  (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  $\leq$

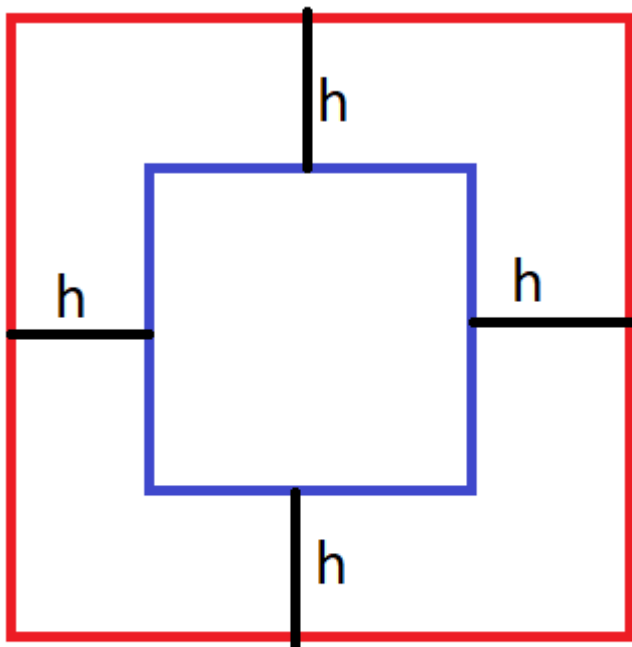
1.  $\lambda A = 0$ . Тогда правая часть  $= 0$ .

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

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

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  $Q$ .



$$h = \frac{\alpha}{2\sqrt{m}}$$

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

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

При этом  $\lambda G$  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  $\epsilon$  так чтобы

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

$G_\epsilon$  - 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  $c_1$ )

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

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,  $\forall A \in \mathbb{M}^m, A \subset O$

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

**TODO: Илья**

## 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.

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

Применить теорему об интеграле по взвешенному образу меры.

## 24 Теорема (принцип Кавальери)

$(X, \alpha, \mu)$  и  $(Y, \beta, \nu)$  — пространства с мерами, причем  $\mu, \nu$  —  $\sigma$ -конечные и полные

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

1. При п.в.  $x$   $C_x$  измеримо ( $\nu$ -измеримо), т.е.  $C_x \in \beta$

2. Функция  $x \rightarrow \nu C_x$  — измеримая (в широком смысле) на  $X$

NB:  $\phi$  — измерима в широком смысле, если она задана п.в.  $x$ , и  $\exists f : X \rightarrow R'$  — 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  $\nu$  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 — дизъюнктивные, но это лечится). Поэтому  $\cap_j (\cup_i A_{i,j}) \in D$ , если  $A_{i,j} \in \rho$  ( $\rho \subset D$ ).

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

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

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

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

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

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

5.  $C$  — неизм,  $mC < +\infty$ . Тогда  $C \in D$ .

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

$C_x = H_x \setminus e_x$  — изм. при п.в.  $x$

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

$\nu C_x = \nu H_x = \nu e_x$  — 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.  $C$  —  $m$ -изм. произвольное

$X = \sqcup X_k, Y = \sqcup Y_n$  ( $\mu X_k$  — кон,  $\nu Y_n$  — кон.).

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

## 25 Теорема Тонелли

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

$\mu, \nu$  —  $\sigma$ -конечны, полные

$m = \mu \times \nu$

$f : X \times Y \rightarrow \bar{R}, f \geq 0$ ,  $f$  — измерима относительно  $m$

Тогда:

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

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

(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  $y$ )

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

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  $\phi_n(x) \rightarrow \phi(x)$

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

## 26 Формула для Бета-функции

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

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

Доказательство:

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

## 27 Объем шара в $\mathbb{R}^m$

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

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

$$= \frac{\pi R^m \Gamma(\frac{1}{2})^{m-2}}{\frac{m}{2} \Gamma(\frac{m}{2})} = \frac{\pi \frac{m}{2}}{\Gamma(\frac{m}{2}+1)} R^m$$

## 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

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

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

- $f \in L_p$   
•  $f_n \rightarrow f$  в  $L_p$

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

- $f_n \xrightarrow{\mu} f$  (либо если  $f_n \rightarrow f$  почти везде)  
•  $|f_n| \leq g$  почти при всех  $n$ ;  $g \in L_p$  **Что значит «почти при всех  $n$ »?**

Тогда:  $f_n \rightarrow f$  в  $L_p$

Доказательство:

1.

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

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

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 сходиться 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:  $L_\infty$  — 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: **TODO!**

## 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:  $\forall f \in L_p(E, \mu) \forall \epsilon > 0 \exists \varphi \in C_0(\mathbb{R}^m) :$   
 $\|f - \varphi|_E\|_p < \epsilon$ . Таким образом достаточно научиться приближать  $f$  и  $\varphi$  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:  $f \in \tilde{C}[0, T] \Rightarrow f$  — рвнм. 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. 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  $[0, T]$ ).

2. **TODO!**

## 34 Теорема об интеграле с функцией распределения

$(\mathbb{R}, B, X)$

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

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

$\mu_H$  — мера Бореля-Стилтьеса (мера Лебега-Стилтьеса на  $B$ )

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.

## 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

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

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

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

Устремляя  $n$  к  $\infty$  получаем требуемое равенство

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

$$|S_n|^2 = \langle \sum_{k=1}^n x_k, \sum_{j=1}^n x_j \rangle = \sum_{k,j} \langle x_k, x_j \rangle = \sum_{k=1}^n \langle x_k, x_k \rangle \text{ (так как}$$

$$k \neq j \Rightarrow \langle x_k, x_j \rangle = 0) = \sum_{k=1}^n |x_k|^2 = C_n$$

$$\text{Аналогично, } ||S_n|^2 - |S_m|^2| = |C_n - C_m|$$

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

## 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  $\{te_k, t \in \mathbb{R}(\mathbb{C})\}$

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

3.  $x = c_k \cdot e_k + z$  ?  $z \perp e_k$  Докажем это:

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

## 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.  $\|x\|^2 = \|S_n\|^2 + \|z\|^2$  (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. Ряд Фурье  $\sum_{k=1}^{+\infty} c_k(x) e_k$  сх-ся 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. Ряд Фурье – ортогональный ряд

его сходимость  $\Leftrightarrow$  сходимости  $\sum_{k=1}^{+\infty} |c_k|^2 \|e_k\|^2$

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

$\{e_k\}$  – орт. сист. 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.  $\{e_k\}$  – замкн.

4.  $\{e_k\}$  – полн.

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)

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

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

### 39.2 $2 \Rightarrow 3$

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

### 39.3 $3 \Rightarrow 4$

$$\text{Пусть } \forall k \quad x_0 \perp e_k \\ c_k(x_0) = \frac{\langle x_0, e_k \rangle}{\|e_k\|^2} = 0 \\ \|x_0\|^2 = \sum |c_k(x_0)|^2 \|e_k\|^2 = 0 \text{ (см. п. 2 из опр.)}$$

### 39.4 $4 \Rightarrow 1$

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

### 39.5 $4 \Rightarrow 5$

$$\text{Пусть } ClLin(e_1, e_2, \dots) \neq \mathbb{H}, x \in \mathbb{H} \setminus ClLin(e_1, e_2, \dots) \\ \text{из т. Рисса-Фишера (2): } x = \sum_{k=1}^{+\infty} c_k e_k + z \Rightarrow \forall k \quad z \perp e_k \Rightarrow x = \sum_{k=1}^{+\infty} c_k e_k \Rightarrow \\ x \in ClLin(e_1, e_2, \dots) \\ \text{Противоречие.}$$

### 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

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

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:

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

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

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

Тогда:

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

и

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



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  $e(t + \pi) = -e(t)$

$$\int_{\mathbb{R}} f(t)e(kt) \stackrel{t=\tau+\frac{\pi}{k}}{=} \int_{\mathbb{R}} f(\tau + \frac{\pi}{k})e(k \cdot (\tau + \frac{\pi}{k})) = - \int_{\mathbb{R}} f(\tau + \frac{\pi}{k})e(k\tau)$$

$$\int_{\mathbb{R}} f(t)e(kt) = \frac{1}{2} \int_{\mathbb{R}} f(t)e(kt) - \frac{1}{2} \int_{\mathbb{R}} f(\tau + \frac{\pi}{k})e(kt) = \frac{1}{2} \int_{\mathbb{R}} (f(t) - f(t + \frac{\pi}{k}))e(kt)$$

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

по непрерывности сдвига

## 42 Принцип локализации Римана. TODO

## 43 Признак Дини. Следствия. TODO.

## 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. х
- 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**  $-p < +\infty$

$$\begin{aligned} |(f * K)(x+h) - (f * K)(x)| &= \left| \int_{-\pi}^{\pi} (f(x+h-t) - f(x-t)) K(t) dt \right| \underset{\text{нер-во Гельдера}}{\leq} \\ &= \left( \int_{-\pi}^{\pi} |f(x+h-t) - f(x-t)|^p dt \right)^{1/p} \left( \int_{-\pi}^{\pi} |K(t)|^q dt \right)^{1/q} = \|K\|_q \left( \int_{-\pi}^{\pi} |f(x+h-t) - f(x-t)|^p dt \right)^{1/p} = \\ &= \|K\|_q \left( \int_{-\pi}^{\pi} |f(y+h) - f(y)|^p dy \right)^{1/p} = \\ &= \|K\|_q \|f(y+h) - f(y)\|_p \xrightarrow{\text{по непр. сдвига}} 0 \end{aligned}$$

$$-p = +\infty$$

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

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

$$\|K\|_1 \cdot \operatorname{esssup}_{t \in [x+\pi, x-\pi]} |f(t+h) - f(t)| \xrightarrow{\text{по непр. сдвига}} 0$$

## 46 Формула Грина

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

$\delta D$  –  $C^2$ -гладкая кривая, тоже ориентировано

$D$  и  $\delta D$  ориентированы согласовано

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

Тогда:

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

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:

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

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

$\Omega$  – эллиптическая, гладкая, двусторонняя поверхность,  $C^2$ –гладкое;

$n_0$  – сторона

$\delta\Omega$  - ориентирована согласовано с  $n_0$

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

Тогда:

$$\int_{\delta\Omega} (P dx + Q dy + R dz) = \iint_{\Omega} ((R'_y - Q'_z) dy dz + (P'_z - R'_x) dz dx + (Q'_x - P'_y) dx dy)$$

Доказательство:

Из соображений линейности интеграла по векторному полю достаточно проверить:

$$\int_{\delta\Omega} P dx = \iint_{\Omega} (P'_z dz dx - P'_y dx dy)$$

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  $\Omega$  в новых координатах, тогда:

$$\begin{aligned} \int_{\delta\Omega} P dx &= \int_L P(x(u, v), y(u, v), z(u, v))(x'_u du + x'_v dv) = \int_L P x'_u du + P x'_v dv \stackrel{\Gamma_{\text{рин}}}{=} \\ &= \iint_G ((P(x, y, z)x'_v)'_u - (P(x, y, z)x'_u)'_v) dudv = \\ &= \iint_G (P'_z(z'_u x'_v - z'_v x'_u) - P'_y(y'_v x'_u - y'_u x'_v)) dudv = \\ &= \iint_G P'_z \begin{vmatrix} z'_u & z'_v \\ x'_u & x'_v \end{vmatrix} dudv - P'_y \begin{vmatrix} x'_u & x'_v \\ y'_u & y'_v \end{vmatrix} dudv = \\ &= \iint_{\Omega} (P'_z dz dx - P'_y dx dy) \end{aligned}$$

что и требовалось доказать

## 48 Формула Гаусса–Остроградского

$V = \{(x, y, z) \in \mathbb{R}^3 : (x, y) \in G, f(x, y) \leq z \leq F(x, y)\}$ ,  $G \subset \mathbb{R}^2$ ,  $\partial G$  – гладкая кривая в  $\mathbb{R}^2$ ,  $F \in "C'(G)"$  (кавычки означают "включая границу, то есть с более широкой гладкой областью"),  $\partial V$  – 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)

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

**49** Соленоидальность бездивергентного векторного поля. TODO.

**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  $\mathbb{X}$

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

Тогда:

•  $\phi$  – сумм.

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

Доказательство: По Гейне:  $y_n \rightarrow a$

$$\begin{aligned} \text{При больших } n \quad \forall x \quad |f(x, y_n) - \phi(x)| < 1 \\ \Rightarrow |\phi(x)| \leq |f(x, y_n)| + 1 \Rightarrow \int_X |\phi(x)| \leq \int_X |f| + \mu X \end{aligned}$$

Из этого следует, что  $\phi$  – суммир.

$$\begin{aligned} \left| \int_X f(x, y_n) d\mu(x) - \int_X \phi \right| &\leq \int_X |f(x, y_n) - \phi(x)| d\mu \leq \sup_{x \in X} |f(x, y_n) - \phi(x)| \mu X \\ \sup_{x \in X} |f(x, y_n) - \phi(x)| \mu X &\xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0 \end{aligned}$$

## 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:

- $\phi$  – 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  $\mathbb{X}$

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

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

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

Тогда:

- $I(y) = \int_X f(x, y) d\mu(x)$  – дифф. в точке  $a$

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

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. TODO
- 53 Теорема Фейера. TODO
- 54 Свойства преобразования Фурье: непрерывность, ограниченность, сдвиг. TODO
- 55 Преобразование Фурье свертки. TODO
- 56 Преобразование Фурье и дифференцирование. TODO
- 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  $\geq 0$ . Первая скобка  $\leq 0$ , 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  $x \in [0; \pi]$ .

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

$$\leq \frac{1}{2\pi} \int_0^x 2 dt = \frac{x}{\pi} \leq 1$$

$$(d) \int_0^x \frac{\sin nt}{\pi t} dt = \int_0^{nx} \frac{\sin v}{\pi v} dv \quad (v = nt).$$

$$0 \leq \int_0^{nx} \frac{\sin v}{\pi v} dv \leq \int_0^\pi \frac{\sin v}{\pi v} dv. \text{ Доказательство методом пристального}$$

$$\text{взгляда на график подынтегральной функции.}$$

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

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

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

$$\int_0^x = \int_0^{2\pi} - \int_x^{2\pi} = 1 - \int_{x-2\pi}^0 = 1 - \int_0^{2\pi-x} \in [-2; 1]$$

## 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. TODO
- 60 Следствие о преобразовании Фурье финитных функций. TODO
- 61 Лемма "о ядре Дирихле". Следствие. TODO
- 62 Теорема о равносходимости ряда Фурье и интеграла Фурье. TODO
- 63 Признак Дирихле–Жордана. TODO
- 64 Лемма к теореме о формуле обращения. TODO
- 65 Формула обращения преобразования Фурье. TODO
- 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

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

Доказательство: TODO