

Теория меры

Определение. $\mu : \mathcal{P} \rightarrow \mathbb{R}$ — **продолжает** $\mu_0 : \mathcal{P}_0 \rightarrow \mathbb{R}$, $\mathcal{P}_0 \subset \mathcal{P}$, если $\mu|_{\mathcal{P}_0} = \mu_0$

Теорема 1 (о Лебеговском продолжении меры).

- $\mathcal{P}_0 \subset X$ — полукольцо
- $\mu_0 : \mathcal{P}_0 \rightarrow \mathbb{R}$ — σ -конечная мера

Тогда $\exists \sigma$ -алгебра $\mathfrak{A} \supset \mathcal{P}_0$, $\exists \mu$ — мера на \mathfrak{A} :

1. μ — продолжение μ_0 на \mathfrak{A}
2. μ — полная мера
3. Если $\tilde{\mu}$ — полная мера на σ -алгебре $\tilde{\mathfrak{A}}$ и $\tilde{\mu}$ — продолжение μ_0 , то $\tilde{\mathfrak{A}} \supset \mathfrak{A}$ и при этом $\tilde{\mu}$ продолжает $\mu : \tilde{\mu}|_{\mathfrak{A}} = \mu$
4. Если \mathcal{P} — полукольцо, такое что $\mathcal{P}_0 \subset \mathcal{P} \subset \mathfrak{A}$ и мера ν — продолжение μ_0 на \mathcal{P} , то $\forall A \in \mathcal{P} \quad \nu(A) = \mu(A)$
5. $\forall A \in \mathfrak{A} \quad \mu A = \inf \left\{ \sum \mu P_k : P_k \in \mathcal{P} : A \subset \bigcup_{k=1}^{+\infty} P_k \right\}$

Доказательство. Не будет, это слишком сложно.

Общая идея следующая: $\forall A \subset X$ положим $\mu^*(A) = \inf \{ \dots \}$ — не аддитивна. $A \subset \bigcup A_k \quad \mu^* A = \sum \mu^* A_k$ □

Следствие 1.

- $A \in \mathfrak{A}$
- $\mu A < +\infty$
- $\varepsilon > 0$

Тогда $\exists P_k \in \mathcal{P}_0 : A \subset \bigcup P_k \quad \mu A < \sum \mu P_k < \mu A + \varepsilon$

Мера Лебега

Теорема 2.

- $\mu : \mathcal{P}^m \rightarrow \mathbb{R}$ — классический объем в \mathbb{R}^m

Тогда μ это σ -конечная мера

Доказательство. σ -конечность очевидна, т.к. можно дизъюнктно разбить \mathbb{R}^m на ячейки.

Докажем счётную аддитивность μ .

Для этого достаточно проверить счётную полуаддитивность:

$$P = [a, b), P_n = [a_n, b_n) \quad P \subset \bigcup P_n \quad \mu P \stackrel{?}{\leq} \sum \mu P_n$$

Если $P = \emptyset$, то утверждение тривиально. Пусть P непустое.

Фиксируем $\varepsilon > 0$. Чуть уменьшим координаты вектора b , так что $[a, b'] \subset [a, b)$ и $\mu(P \setminus [a, b')) < \varepsilon$. Последняя формула некорректна, т.к. $P \setminus [a, b')$ не обязательно ячейка. Но оно представимо в виде $\bigsqcup D_j$, поэтому под $\mu(P \setminus [a, b'))$ подразумевается $\sum \mu D_j$. Также можно было записать $\mu P - \mu[a, b') < \varepsilon$ вместо этих трюков.

Уменьшим слегка координаты векторов a_n , так что $(a'_n, b_n) \supset [a_n, b_n)$, $\mu([a'_n, b_n) \setminus [a_n, b_n)) < \frac{\varepsilon}{2^n}$. Эта запись также некорректна, поэтому напомним $\mu[a'_n, b_n) - \mu[a_n, b_n) < \frac{\varepsilon}{2^n}$.

$$\underbrace{[a, b']}_{\text{комп.}} \subset \bigcup (a'_n, b_n) \Rightarrow \exists \text{ конечное подпокрытие: } [a, b'] \subset \bigcup_{n=1}^N (a'_n, b_n) \Rightarrow [a, b'] \subset \bigcup_{n=1}^N [a'_n, b_n)$$

$$\text{Тогда } \mu[a, b') \leq \sum_{n=1}^N \mu[a'_n, b_n)$$

$$\begin{aligned} \mu P - \varepsilon &\leq \sum_{n=1}^N \left(\mu P_n + \frac{\varepsilon}{2^n} \right) \\ \mu P - \varepsilon &\leq \sum_{n=1}^{+\infty} \mu P_n + \varepsilon \end{aligned}$$

□

Определение. Мера Лебега в \mathbb{R}^m — лебеговское продолжение классического объема.

\mathfrak{M}^m — σ -алгебра, на которой задана мера Лебега. Тогда множество называется **измеримым по Лебегу**

Свойства меры Лебега:

1. (a) A_1, A_2, \dots — измеримы $\Rightarrow A_1 \cap A_2, A_1 \cup A_2, A_1 \cap A_2 \cap A_3, \dots, A_1 \cup A_2 \cup A_3, \dots$ — измеримы.
- (b) $\forall n \quad \lambda A_n = 0 \Rightarrow \lambda(\bigcup A_n) = 0$
- (c) $\lambda A_n = 0, B \subset A \Rightarrow B$ — измеримо, $\lambda B = 0$

Пример. $\mathbb{Q} \subset \mathbb{R}$ — измеримо, $\lambda_1 \mathbb{Q} = 0$

Доказательство. $\forall x \in \mathbb{R} \quad \{x\} = \bigcap_n [x, x + \frac{1}{n})$

$$0 \leq \lambda\{x\} \leq \lambda[x, x + \frac{1}{n}) = \frac{1}{n} \Rightarrow \lambda\{x\} = 0$$

\mathbb{Q} — объединение одноточечных множеств. □

2. \mathfrak{M}^m содержит все открытые и замкнутые множества.

Лемма 1.

- (a) $O \subset \mathbb{R}^m$ — открытое. Тогда $O = \bigsqcup Q_i$, где Q_i — ячейки с рациональными координатами. Можно считать, что ячейки кубические.
- (b) Можно считать, что $\overline{Q_i} \subset O$
- (c) E — измеримо, $\lambda E = 0$. Тогда $\forall \varepsilon > 0 \quad E \subset \bigcup Q_i : Q_i$ — кубические ячейки и $\sum \lambda Q_i < \varepsilon$

Примечание. $\forall \varepsilon > 0 \quad \exists (B_i)$ — шары: $E \subset \bigcup B_i, \sum \lambda B_i < \varepsilon$

$$Q\left(x, \frac{R}{\sqrt{m}}\right) \subset B(x, R) \subset Q(x, R)$$

$$\left(\frac{2R}{\sqrt{m}}\right)^m \leq \lambda B \leq \lambda Q(x, R) = (2R)^m$$

Доказательство.

- (a, b) $\forall x \in O$ пусть $Q(x)$ — какая угодно ячейка с рациональными координатами, $Q(x) \subset O$ (можно потребовать $\overline{Q(x)} \subset O$, Q — куб, координаты двоично-рациональны для второго пункта).

$O = \bigcup_{x \in O} Q(x)$ — здесь не более чем счётное множество различных ячеек.

$\Rightarrow O = \bigcap_{i=1}^{\infty} Q(x_i)$. Сделаем ячейки дизъюнктными: $Q_1 := Q(x_1), Q(x_2) \setminus Q(x_1) = \bigcup D_j$. Переобозначим D_j как $Q_2, Q_3 \dots Q_k$. Аналогично для всех $Q(x_i)$.

Можно считать, что координаты всех ячеек двоично рациональны.

Ячейки можно подразбить, чтобы они стали кубическими: пусть 2^l — самый крупный знаменатель. Тогда $[a_i, b_i]$ — конечное объединение кубических ячеек со стороной $\frac{1}{2^l}$

- (c) Следует из пункта 5 теоремы о продолжении Лебега:

$$\forall \varepsilon > 0 \quad \exists \text{ ячейки } P_k \quad E \subset \bigcup P_k \quad 0 = \lambda E \leq \sum \lambda P_k \leq \varepsilon$$

$\exists \tilde{P}_k$ — двоично-рациональные ячейки:

$$P_k \subset \tilde{P}_k \quad 0 = \lambda E \leq \sum \lambda_k \tilde{P}_k \leq 2\varepsilon$$

Можно разбить \tilde{P}_k на конечное число кубов.

□

Определение. \mathfrak{B} — борелевская σ -алгебра (в \mathbb{R}^m или в метрическом пространстве) — минимальная σ -алгебра, которая содержит все открытые множества.

$$\mathfrak{M}^m \supset \mathfrak{B}$$

Пример. Канторово множество в \mathbb{R} :

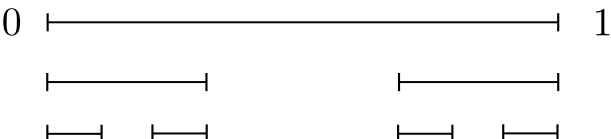
$$\begin{aligned} K_0 &= [0, 1] \\ K_1 &= \left[0, \frac{1}{3}\right] \cup \left[\frac{2}{3}, 1\right] \\ K_2 &= \left[0, \frac{1}{9}\right] \cup \left[\frac{2}{9}, \frac{1}{3}\right] \cup \left[\frac{2}{3}, \frac{7}{9}\right] \cup \left[\frac{8}{9}, 1\right] \\ &\vdots \end{aligned}$$


Рис. 1: Множество Кантора

$$\mathcal{K} = \bigcup K_i \text{ — измеримо, } \lambda \mathcal{K} = 0, \lambda(K_i) = \left(\frac{2}{3}\right)^i$$

Также можно задать множество Кантора следующим образом:

$$\mathcal{K} = \{x \in [0, 1] : \text{троичная запись } x \text{ содержит только цифр } 0 \text{ и } 2\}$$

3. \exists неизмеримые по Лебегу множества, т.е. не принадлежащие \mathfrak{M}

Зададим отношение \sim на \mathbb{R} : $x \sim y \Leftrightarrow x - y \in \mathbb{Q}$

$\mathbb{R}/\mathbb{Q} = A$ — из каждого класса эквивалентности взяли по одной точке. Можно считать, что $A \subset [0, 1]$

Очевидно, что $\bigsqcup_{q \in \mathbb{Q}} (A + q) = \mathbb{R}$

$$[0, 1] \stackrel{(1)}{\subset} \bigsqcup_{q \in \mathbb{Q} \cap [-1, 1]} (A + q) \stackrel{(2)}{\subset} [-1, 2]$$

Измеримо ли A ? Предположим, что да.

Очевидно $\forall q \quad \lambda A = \lambda(A + q)$ по пункту 5 теоремы о продолжении меры.

Из (1):

$$\lambda[0, 1] = 1 \leq \sum_q \lambda(A + q) = \sum_q \lambda(A) \Rightarrow \lambda A > 0$$

Из (2):

$$\lambda\left(\bigcup_q (A + q)\right) = \sum_q \lambda A \leq \lambda[-1, 2] = 3 \Rightarrow \lambda A = 0$$

Противоречие $\Rightarrow A$ неизмеримо.

4. $A \in \mathfrak{M}$

- A — ограничено $\Rightarrow \lambda A < +\infty$
- A — открыто $\Rightarrow \lambda A > 0$ — из леммы.
- $\lambda A = 0 \Rightarrow A$ не имеет внутренних точек.

5. $A \in \mathfrak{M}^m$. Тогда $\forall \varepsilon > 0$

- \exists открытое $G_\varepsilon \supset A : \lambda(G_\varepsilon \setminus A) < \varepsilon$
- \exists замкнутое $F_\varepsilon \subset A : \lambda(A \setminus F_\varepsilon) < \varepsilon$

Доказательство.

(a) λA — кон.

$$\lambda A = \inf \left\{ \sum_i \lambda P_i : A \subset \bigcup P_i, P_i \in \mathcal{P} \right\}$$

Чуть “раздуем” эти $P_i = [a_i, b_i) \rightsquigarrow (a'_i, b_i) \subset [a'_i, b_i]$

$$\lambda[a'_i, b_i] \leq \lambda P_i + \frac{\varepsilon}{2^i}$$

$$A \subset \underbrace{\bigcup (a'_i, b_i)}_{G_{2\varepsilon}} \subset [a'_i, b_i]$$

$$\lambda A \leq \lambda G_{2\varepsilon} \leq \sum \lambda[a'_i, b_i] \leq \sum \left(\lambda P_i + \frac{\varepsilon}{2^i} \right) \leq \lambda A + 2\varepsilon$$

(b) $\lambda A = +\infty$. Используем σ -конечность: $\mathbb{R}^m = \bigsqcup_{j=1}^{+\infty} Q_j$

$$\exists G_{\varepsilon,j} - \text{откр. } (A \cap Q_j) \subset G_{\varepsilon,j} \quad \lambda(G_{\varepsilon,j} \setminus (A \cap Q_j)) < \frac{\varepsilon}{2^j}$$

$$A = \bigsqcup (A \cap Q_j) \subset \bigcup G_{\varepsilon,j} =: G_\varepsilon$$

$$\lambda(G_\varepsilon \setminus A) \leq \sum \lambda(G_{\varepsilon,j} \setminus (A \cap Q_j)) \leq \varepsilon$$

Очевидно: $G_\varepsilon \setminus A \subset \bigcup_j (G_{\varepsilon,j} \setminus (A \cap Q_j))$

(с) Для F_ε — переходим к дополнению:

Для A^c подбираем G_ε , $A^c \subset G_\varepsilon$

$$A \supset (G_\varepsilon)^c =: F_\varepsilon$$

$$G_\varepsilon \setminus A^c = A \setminus (G_\varepsilon)^c$$

$$\lambda(G_\varepsilon \setminus A^c) < \varepsilon \Rightarrow \lambda(A \setminus F) < \varepsilon$$

□