

Bachelorarbeit

Maße auf polnischen Räumen und die Wassersteinmetrik

Daniel Herbst

Datum der Abgabe

Betreuung: Prof. Dr. Roland Schnaubelt

Fakultät für Mathematik

Karlsruher Institut für Technologie

Inhaltsverzeichnis

1	Einleitung	2
2	Grundlagen	3
2.1	Topologische Grundlagen	3
2.2	Polnische Räume	5
2.3	Borel-Maße auf topologischen Räumen	9
3	Schwache Topologie und schwache Konvergenz	13
3.1	Definitionen	13
3.2	Beziehung zur Schwach-*-Konvergenz	13
3.3	Charakterisierungen schwacher Konvergenz	14
4	Eigenschaften der schwachen Topologie	17
5	Straffheit und der Satz von Prokhorov	23
6	Die Wassersteinmetrik	27
6.1	Kopplungen	27
6.2	Optimaler Transport	28
6.3	Wassersteinmetriken	29

1 Einleitung

Fehlt noch.

2 Grundlagen

2.1 Topologische Grundlagen

Netze

Im Allgemeinen beschreiben Folgen und deren Konvergenz die Eigenschaften eines topologischen Raumes nur unzureichend: Beispielsweise ist Folgenstetigkeit nicht notwendigerweise äquivalent zu Stetigkeit und zwei unterschiedliche Topologien auf einer gegebenen Menge können generell dieselben konvergenten Folgen haben. Um solche Probleme im Folgenden zu umgehen, führen wir das Konzept des Netzes aus der mengentheoretischen Topologie ein. Netze verallgemeinern Folgen und können in vielerlei Hinsicht die Eigenschaften eines topologischen Raumes besser erfassen.

Überwiegend orientieren wir uns in diesem Abschnitt an [Sim15, Kapitel 2.6].

Definition 2.1 (Gerichtete Menge). *Sei I eine Menge. Eine Relation \preceq auf I mit*

- (a) $\forall \iota \in I : \iota \preceq \iota$
- (b) $\forall \iota, \kappa, \lambda \in I : \iota \preceq \kappa \text{ und } \kappa \preceq \lambda \text{ impliziert } \iota \preceq \lambda$
- (c) $\forall \iota, \kappa \in I : \exists \lambda \in I : \iota \preceq \lambda \text{ und } \kappa \preceq \lambda$

heißt gerichtet. In diesem Fall nennen wir das Paar (I, \preceq) auch eine gerichtete Menge.

Definition 2.2 (Netz). *Sei X eine Menge und (I, \preceq) eine gerichtete Menge. Ein Netz in X ist dann eine Abbildung $x : I \rightarrow X$. In diesem Fall schreiben wir auch $x = (x_\iota)_{\iota \in I}$.*

Definition 2.3 (Konvergenz von Netzen). *Sei X ein topologischer Raum und sei $x = (x_\iota)_{\iota \in I}$ ein Netz in X . Wir sagen, dass x gegen $z \in X$ konvergiert, falls es für jede Umgebung U von z ein derartiges $\iota_0 \in I$ gibt, dass $x_\iota \in U$ für alle $\iota_0 \preceq \iota \in I$ erfüllt ist. In diesem Fall schreiben wir auch $\lim_{\iota \rightarrow \infty} x_\iota = z$ oder $x_\iota \rightarrow z, \iota \rightarrow \infty$.*

Bemerkung. *Offenbar sind Folgen einfach Netze, bei denen $(I, \preceq) := (\mathbb{N}, \leq)$ gewählt wird. Der Konvergenzbegriff von Netzen stimmt dann auch mit dem von uns bekannten Konvergenzbegriff von Folgen in topologischen Räumen überein.*

Wie bereits angekündigt lassen sich topologische Räume im Allgemeinen viel besser über Netze charakterisieren als lediglich über Folgen. Der nächste Satz konkretisiert dies.

Satz 2.4. *Seien X und Y topologische Räume. Dann gelten die folgenden Aussagen:*

- (a) *Eine Teilmenge $C \subseteq X$ ist genau dann abgeschlossen, wenn der Grenzwert $z \in X$ eines jeden konvergenten Netzes $x = (x_\iota)_{\iota \in I}$ in X bereits in C liegt.*
- (b) *Eine Funktion $f : X \rightarrow Y$ ist genau dann stetig, wenn für jedes konvergente Netz $x = (x_\iota)_{\iota \in I}$ in X*

$$\lim_{\iota \rightarrow \infty} f(x_\iota) = f\left(\lim_{\iota \rightarrow \infty} x_\iota\right)$$

erfüllt ist.

- (c) *Zwei Topologien auf X sind genau dann identisch, wenn alle Netze in X bezüglich beiden Topologien dasselbe Konvergenzverhalten aufweisen.*

Beweis. Siehe [Sim15, Satz 2.6.3]. □

Bemerkung. *Auch wenn man in spezielleren Fällen (wie etwa bei metrisierbarem X) problemlos mit Folgen arbeiten kann, sei an dieser Stelle angemerkt, dass im Allgemeinen keine der drei Aussagen gelten, wenn man „Netz“ durch „Folge“ ersetzt (vgl. [Sim15, Beispiel 2.6.1]).*

Für reelle Netze können wir in Analogie zu Folgen auch den Limes Superior bzw. Inferior von Netzen definieren. Hierfür orientieren wir uns an [Meg98, Kapitel 2.1 und Aufgabe 2.55] und [AB06, Kapitel 2.4].

Definition 2.5 (Limes Superior und Inferior von Netzen). *Sei $x = (x_\iota)_{\iota \in I}$ ein Netz in \mathbb{R} . Dann definieren wir*

$$\limsup_{\iota \rightarrow \infty} x_\iota := \inf_{\iota \in I} \sup_{\iota \preceq \kappa} x_\kappa \quad \text{bzw.} \quad \liminf_{\iota \rightarrow \infty} x_\iota := \sup_{\iota \in I} \inf_{\iota \preceq \kappa} x_\kappa$$

und nennen diese den Limes Superior bzw. Limes Inferior von x .

Bemerkung. Offenbar ist auch diese Definition mit den bekannten Begriffen für reelle Folgen kompatibel. Die meisten grundlegenden Eigenschaften der Konvergenz und des Limes Superior bzw. Inferior von reellen Folgen lassen sich auch auf reelle Netze übertragen, wie etwa die üblichen Rechenregeln für die Grenzwerte von Summen und Produkten reeller Folgen.

Außerdem gelten etwa für reelle Netze $x = (x_\iota)_{\iota \in I}$ und $y = (y_\iota)_{\iota \in I}$ die Ungleichungen

$$\begin{aligned} \limsup_{\iota \rightarrow \infty} (x_\iota + y_\iota) &\leq \limsup_{\iota \rightarrow \infty} x_\iota + \limsup_{\iota \rightarrow \infty} y_\iota \quad \text{und} \\ \liminf_{\iota \rightarrow \infty} (x_\iota + y_\iota) &\geq \liminf_{\iota \rightarrow \infty} x_\iota + \liminf_{\iota \rightarrow \infty} y_\iota, \end{aligned}$$

sofern die Summen jeweils definiert sind und mit Gleichheit, falls eines der beiden Netze konvergiert (vgl. [Meg98, Aufgabe 2.55 (e)]). Nach [Meg98, Aufgabe 2.55 (i)] ist für ein konvergentes Netz $x = (x_\iota)_{\iota \in I}$ in \mathbb{R} ebenfalls

$$\lim_{\iota \rightarrow \infty} x_\iota = \limsup_{\iota \rightarrow \infty} x_\iota = \liminf_{\iota \rightarrow \infty} x_\iota.$$

Initialtopologie

Wir möchten nun noch ein weiteres Konzept aus der Topologie, die sogenannte *Initialtopologie* einführen. Auch wenn es sich hier um einen sehr elementaren Begriff handelt, wird dieser uns an späterer Stelle in Kombination mit Hilfssatz 2.7 häufig ermöglichen, gewisse Topologien und deren Konvergenzverhalten in knapper Form auszudrücken.

Der folgende Abschnitt orientiert sich an [AB06, Kapitel 2.13].

Definition 2.6 (Initialtopologie). *Sei X eine Menge, A eine beliebige Indexmenge und für jedes $\alpha \in A$ sei Y_α ein topologischer Raum sowie $f_\alpha: X \rightarrow Y_\alpha$ eine Abbildung. Die Initialtopologie auf X bezüglich der Abbildungen f_α , $\alpha \in A$ ist dann die kleinste Topologie auf X , bezüglich der alle Abbildungen f_α , $\alpha \in A$ stetig sind.*

Bemerkung (Produkttopologie). *Sei A eine beliebige Indexmenge und sei für jedes $\alpha \in A$ ein topologischer Raum X_α gegeben. Die Produkttopologie der X_α , $\alpha \in A$ auf dem kartesischen Produkt $X := \prod_{\alpha \in A} X_\alpha$ ist dann offensichtlich die Initialtopologie der kanonischen Projektionen $\pi_\beta: X \rightarrow X_\beta$, $x = (x_\alpha)_{\alpha \in A} \mapsto x_\beta$, $\beta \in A$.*

Hilfssatz 2.7 (Konvergenz bezüglich der Initialtopologie). *In der Situation von Definition 2.6 konvergiert ein Netz $x = (x_\iota)_{\iota \in I}$ in X genau dann gegen ein $z \in X$, wenn für alle $\alpha \in A$ die Konvergenz $f_\alpha(x_\iota) \rightarrow f_\alpha(z)$, $\iota \rightarrow \infty$ gilt.*

Beweis. Wegen Satz 2.4 (b) folgt die Hinrichtung direkt aus der Stetigkeit der Abbildungen f_α , $\alpha \in A$.

Für die Rückrichtung möchten wir zeigen, dass für alle Umgebungen V von z ein derartiges $\iota_0 \in I$ existiert, dass $x_\iota \in V$ für $\iota_0 \preceq \iota$ gilt. Man bemerke zunächst, dass die

Menge alle Urbilder von offenen Mengen in Y_α unter f_α für alle $\alpha \in A$ eine Subbasis der Topologie von X ist. Daher genügt es, Mengen der Form

$$\tilde{V} := \bigcap_{i=1}^n f_{\alpha_i}^{-1}(U_i) \subseteq X$$

zu betrachten, wobei $\alpha_1, \dots, \alpha_n \in A$ sind und U_i offene Umgebungen von $f_{\alpha_i}(z)$, $i \in \{1, \dots, n\}$. Sei nun ein solches \tilde{V} gegeben. Dann können wir für $i \in \{1, \dots, n\}$ jeweils ein $\iota_0^{(i)} \in I$ finden, sodass $x_\iota \in f_{\alpha_i}^{-1}(U_i)$ für $\iota_0^{(i)} \preceq \iota$ gilt. Sukzessive Anwendung von Eigenschaft (c) in Definition 2.1 liefert ein $\iota_0 \in I$ mit $x_\iota \in \tilde{V}$ für $\iota_0 \preceq \iota$, was schließlich die Konvergenz $x_\iota \rightarrow z$, $\iota \rightarrow \infty$ bedeutet. \square

2.2 Polnische Räume

In diesem Abschnitt beschäftigen wir uns mit den grundlegenden Eigenschaften von polnischen Räumen, einer Klasse von speziellen topologischen Räumen.

Wir orientieren uns hierbei an den relevanten Teilen aus [Sim15, Kapitel 4.14].

Definition 2.8 (Polnischer Raum). *Ein polnischer Raum ist ein separabler und vollständig metrisierbarer topologischer Raum.*

Es sei hier anzumerken, dass dies tatsächlich eine rein topologische Eigenschaft ist: Wir fordern für einen polnischen Raum X nur die Existenz einer Metrik, die die Topologie von X erzeugt und bezüglich der X vollständig ist, möchten uns aber die Flexibilität bewahren, diese Metrik nicht zu fixieren und bei Bedarf zwischen verschiedenen solchen Metriken zu wechseln. Es kann durchaus Metriken geben, die X zwar metrisieren, jedoch nicht vollständig. Beispielsweise ist \mathbb{R} ausgestattet mit der Standardtopologie offensichtlich ein polnischer Raum, denn \mathbb{R} ist separabel und die euklidische Metrik metrisiert \mathbb{R} vollständig. Allerdings ist $(0, 1)$ als Teilraum von \mathbb{R} mit der euklidischen Metrik zwar separabel, aber nicht vollständig. Da $(0, 1)$ homöomorph zu \mathbb{R} ist, ist $(0, 1)$ aber dennoch ein polnischer Raum.

Der folgende Hilfssatz 2.9 behandelt die recht elementare Tatsache, dass sich in metrischen Räumen abgeschlossene Mengen von außen gewissermaßen „beliebig gut“ durch offene Mengen approximieren lassen. Diese Erkenntnis werden wir im weiteren Verlauf der Arbeit noch häufiger benötigen.

Hilfssatz 2.9. *Sei (X, d) ein metrischer Raum und $C \subseteq X$ eine abgeschlossene Teilmenge. Ferner definieren wir für $n \in \mathbb{N}$*

$$A_n := \left\{ y \in X \mid d(y, C) < \frac{1}{n} \right\} \quad \text{und} \quad f_n: X \rightarrow \mathbb{R}, \quad x \mapsto \max(0, 1 - nd(x, C)),$$

wobei wir $d(y, C) := \inf_{x \in C} d(y, x)$ setzen. Dann gilt:

- (a) A_n ist offen für alle $n \in \mathbb{N}$.
- (b) $C = \bigcap_{n \in \mathbb{N}} A_n$, insbesondere ist C also eine G_δ -Menge.
- (c) Für alle n ist $f_n|_{A_n^c} = 0$ und f_n ist Lipschitzstetig.
- (d) $f_n \downarrow \mathbb{1}_C$.

Beweis. Aussage (a) folgt aus der Stetigkeit von $y \mapsto d(y, C)$.

Weiter ist $C \subseteq A_n$ für alle $n \in \mathbb{N}$ und damit $C \subseteq \bigcap_{n \in \mathbb{N}} A_n$. Umgekehrt gibt es für ein beliebiges $y \in \bigcap_{n \in \mathbb{N}} A_n$ eine Folge $(x_n)_{n \in \mathbb{N}} \in C^\mathbb{N}$ mit $x_n \rightarrow y$. Wegen der Abgeschlossenheit von C liegt y damit in C , sodass (b) gezeigt ist.

Aussage (c) ist klar (f_n ist als Komposition Lipschitzstetiger Funktionen selbst Lipschitzstetig).

Schließlich fällt f_n und für $x \in C$ gilt $f_n(x) = 1$. Für $x \in C^c$ ist $d(x, C) > 0$ und damit

$$f_n(x) = \max(0, 1 - nd(x, C)) \rightarrow 0, \quad n \rightarrow \infty,$$

womit die Behauptung folgt. \square

Im Folgenden lernen wir Eigenschaften und Charakterisierungen polnischer Räume kennen.

Der folgende Satz beantwortet uns zunächst, welche Teilmengen eines polnischen Raumes selbst wieder polnisch sind:

Satz 2.10 (Alexandroff). *Sei X ein polnischer Raum. Dann ist $A \subseteq X$ genau dann selbst ein polnischer Raum bezüglich der Teilraumtopologie, wenn $A \subseteq X$ eine G_δ -Teilmenge ist.*

Beweis. Der Beweis der Hinrichtung folgt [Jor14, Satz 7], während der Beweis der Rückrichtung eine Anpassung des Beweises von Satz 4.14.6 aus [Sim15, Kapitel 4.14] ist.

Für die Hinrichtung sei $A \subseteq X$ eine G_δ -Teilmenge und seien $U_n \subseteq X$, $n \in \mathbb{N}$ offene Mengen mit $A = \bigcap_{n \in \mathbb{N}} U_n$, wobei wir außerdem $C_n := U_n^c$ schreiben. Ferner sei d eine Metrik, die X vollständig metrisiert. Da A als Teilmenge eines separablen metrischen Raumes selbst separabel ist, genügt es, die vollständige Metrisierbarkeit von A zu beweisen.

Für $x, y \in A$ definieren wir

$$\tilde{d}(x, y) := d(x, y) + \sum_{n=1}^{\infty} \min\left(\frac{1}{2^n}, \left|\frac{1}{d(x, C_n)} - \frac{1}{d(y, C_n)}\right|\right).$$

Offensichtlich ist \tilde{d} eine Metrik auf A , die dieselbe Topologie wie d erzeugt.

Wir möchten nun zeigen, dass (A, \tilde{d}) vollständig ist. Sei dazu $(x_k)_k \in A^{\mathbb{N}}$ eine Cauchyfolge. Wegen $d \leq \tilde{d}$ ist $(x_k)_k$ dann auch bezüglich d eine Cauchyfolge und die Vollständigkeit von (X, d) liefert die Existenz eines Grenzwertes $x \in X$. Angenommen $x \notin A$, so gibt es ein $m \in \mathbb{N}$ mit $x \in C_m$. Damit ist aber für alle $k \in \mathbb{N}$

$$\sup_{l \geq k} \tilde{d}(x_k, x_l) \geq \sup_{l \geq k} \sum_{n=1}^{\infty} \min\left(\frac{1}{2^n}, \left|\frac{1}{d(x_k, C_n)} - \frac{1}{d(x_l, C_n)}\right|\right) \geq \frac{1}{2^m} > 0,$$

was der Tatsache widerspricht, dass $(x_k)_k$ eine Cauchyfolge bezüglich \tilde{d} ist. Also muss $x \in A$ gelten. Aus der Stetigkeit von $x \mapsto d(x, C_n)$ folgt mit dem Satz von Lebesgue unmittelbar die Konvergenz $\tilde{d}(x_k, x) \rightarrow 0$ für $k \rightarrow \infty$, also ist (A, \tilde{d}) vollständig und A damit selbst ein polnischer Raum.

Nun beweisen wir noch die Rückrichtung. Sei dazu $A \subseteq X$ eine derartige Teilmenge, dass A bezüglich der Teilraumtopologie selbst polnisch ist. \tilde{d} metrisiere im Folgenden A vollständig. Sicherlich ist $B_{1/k}(x_m) \subseteq A$ für alle $k, m \in \mathbb{N}$ relativ offen, also gibt es jeweils offene Mengen $V_{k,m} \subseteq X$ mit

$$B_{1/k}(x_m) = V_{k,m} \cap A. \quad (2.1)$$

Wir möchten jetzt zeigen, dass

$$A = \overline{A} \cap \bigcap_{k \in \mathbb{N}} \left(\bigcup_{m \in \mathbb{N}} V_{k,m} \right) \quad (2.2)$$

gilt. Weil \overline{A} nach Hilfssatz 2.9 als abgeschlossene Menge eine G_δ -Menge ist, folgt aus (2.2) direkt die Aussage (b).

Für jedes $m \in \mathbb{N}$ ist sicherlich $A \subseteq \bigcup_{m \in \mathbb{N}} V_{k,m}$, weshalb „ \subseteq “ in (2.2) unmittelbar folgt. Wir nehmen nun an, dass z in der rechten Seite von (2.2) liegt. Dann gibt es für jedes $k \in \mathbb{N}$ ein $m_k \in \mathbb{N}$ mit $z \in V_{k,m_k}$. Ferner existiert wegen $z \in \overline{A}$ eine Folge $(y_k)_k \in A^{\mathbb{N}}$ mit $y_k \rightarrow z$, wobei wir zusätzlich $y_k \in \bigcap_{j=1}^k V_{j,m_j}$ fordern. Weil damit nach (2.1) auch für alle $k \in \mathbb{N}$

$$y_k \in \bigcap_{j=1}^k B_{1/k}(x_m)$$

gilt, ist $(y_k)_k$ eine Cauchyfolge bezüglich \tilde{d} . Aufgrund der Vollständigkeit von (A, \tilde{d}) gibt es also ein $y \in A$ mit $y_k \rightarrow y$, was $z = y \in A$ und damit „ \supseteq “ in (2.2) impliziert. \square

Mit dem *Hilbertwürfel* möchten wir uns nun einen speziellen polnischen Raum ansehen, der sich später in gewisser Weise als universell für alle polnischen Räume erweisen wird.

Definition 2.11 (Hilbertwürfel). *Der Hilbertwürfel ist der topologische Raum $H = [0, 1]^{\mathbb{N}}$ ausgestattet mit der Produkttopologie, also der Initialtopologie bezüglich aller Projektionen $\pi_n: H \rightarrow [0, 1]$, $x \mapsto x_n$, $n \in \mathbb{N}$.*

Einige grundlegende Eigenschaften des Hilbertwürfels fassen wir im folgenden Hilfssatz zusammen.

Hilfssatz 2.12. *Für den Hilbertwürfel H gelten folgende Aussagen:*

- (a) *Eine Folge $(x^{(k)})_k \in H^{\mathbb{N}}$ konvergiert genau dann gegen ein $x \in H$, wenn alle Komponenten konvergieren, also, wenn $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n^{(k)} = x_n$ für alle $n \in \mathbb{N}$ ist.*
- (b) *Setzen wir für $x, y \in H$*

$$\rho(x, y) := \max_{n \in \mathbb{N}} \frac{|x_n - y_n|}{2^n},$$

so definiert ρ eine Metrik, die H metrisiert.

- (c) *H ist kompakt.*

Beweis. Aussage (a) folgt direkt aus Hilfssatz 2.7.

Für den Beweis von (b) bemerke man zunächst, dass Mengen der Form

$$U = \prod_{n=1}^{\infty} U_n, \quad U_n \subseteq [0, 1] \text{ offen}, \quad U_n = [0, 1] \text{ für fast alle } n \quad (2.3)$$

eine Basis der Topologie von H bilden.

Offenbar wird durch ρ aus (b) eine Metrik auf H definiert. Es genügt also zu zeigen, dass ρ die Topologie von H induziert. Für $x \in H$ und $r > 0$ ist $B_r(x) = \prod_{n=1}^{\infty} B_{2^{-n}r}(x_n) \subseteq H$ offen. Ist nun $U = \prod_{n=1}^{\infty} U_n$ wie in (2.3), so lässt sich leicht einsehen, dass es für jedes $x \in U$ ein $r > 0$ gibt mit $B_r(x) \subseteq U$, also ist U offen bezüglich der von ρ erzeugten Topologie und insgesamt wird H von ρ metrisiert.

Der aus der Topologie bekannte *Satz von Tychonoff* (vgl. [Sim15, Satz 2.7.1]) liefert unmittelbar die Kompaktheit von H . \square

Bemerkung. *Insbesondere handelt es sich bei H um einen polnischen Raum, denn alle kompakten metrischen Räume sind insbesondere separabel und vollständig und damit auch polnisch.*

H erfüllt nun die folgende Universalitätseigenschaft.

Satz 2.13 (Universalitätseigenschaft des Hilbertwürfels). *Ein topologischer Raum X ist genau dann separabel und metrisierbar, wenn X homöomorph zu einer Teilmenge von H ist.*

Ferner ist X genau dann polnisch, wenn X homöomorph zu einer G_δ -Teilmenge von H ist.

Wir werden den Beweis von Satz 2.13 simultan für metrisierbare und separable bzw. für polnische Räume führen, benötigen hierfür aber zunächst noch einen Hilfssatz.

Hilfssatz 2.14. *Sei (X, d) ein separabler metrischer Raum und sei $\mathcal{D} := \{x_n \mid n \in \mathbb{N}\} \subseteq X$ eine abzählbare dichte Teilmenge. Außerdem setzen wir*

$$\varphi: X \rightarrow H, \quad x \mapsto (\min(1, d(x, x_n)))_n. \quad (2.4)$$

Dann ist φ ein Homöomorphismus zwischen X und $\varphi(X)$.

Beweis. Wir zeigen zunächst, dass φ injektiv ist. Seien dazu $y, z \in H$ mit $\varphi(y) = \varphi(z)$, also gilt

$$\min(1, d(y, x_n)) = \min(1, d(z, x_n)) \quad (2.5)$$

für alle $n \in \mathbb{N}$. Weil es eine Folge $(y_n)_n \in \mathcal{D}^\mathbb{N}$ mit $y_n \rightarrow y$ gibt und diese wegen (2.5) auch gegen z konvergiert, folgt die Gleichheit von y und z .

Die Stetigkeit von φ folgt direkt, weil die Komponentenfunktionen $x \mapsto \min(1, d(x, x_n))$ jeweils stetig sind. Seien nun $(y_k)_k \in X^\mathbb{N}$ und $y \in X$ mit $\varphi(y_k) \rightarrow \varphi(y)$, also

$$\min(1, d(y_k, x_n)) \rightarrow \min(1, d(y, x_n)), \quad k \rightarrow \infty \quad (2.6)$$

für alle $n \in \mathbb{N}$. Wählt man nun $\varepsilon < 1$ beliebig, so existiert ein $n \in \mathbb{N}$ mit $d(y, x_n) \leq \varepsilon$. Wegen (2.6) ist dann auch $d(y_k, x_n) \rightarrow d(y, x_n)$, $k \rightarrow \infty$. Es gilt also die Ungleichung

$$\limsup_{k \rightarrow \infty} d(y_k, y) \leq \limsup_{k \rightarrow \infty} d(y_k, x_n) + d(y, x_n) \leq 2\varepsilon$$

und mit $\varepsilon \rightarrow 0$ folgt die Stetigkeit von φ^{-1} , womit wir nachgewiesen haben, dass φ ein Homöomorphismus auf sein Bild ist. \square

Beweis von Satz 2.13. Da wir in Hilfssatz 2.14 bereits gesehen haben, dass jeder separable metrisierbare Raum homöomorph zu einer Teilmenge des Hilbertwürfels H ist und jede Teilmenge von H separabel und metrisierbar ist, folgt der erste Teil von Satz 2.13.

Sei X nun ein polnischer Raum und fixiere eine Metrik d , die X vollständig metrisiert. Nach Hilfssatz 2.14 ist X via $\varphi: X \rightarrow H$ aus (2.6) homöomorph zu einer Teilmenge von H und da H selbst polnisch ist, muss $\varphi(X) \subseteq H$ nach Satz 2.10 eine G_δ -Teilmenge sein. Ferner folgt aus demselben Satz, dass jede G_δ -Teilmenge von H polnisch ist. \square

Folgerung 2.15. *Sei X_n für jedes $n \in \mathbb{N}$ ein topologischer Raum. Dann gelten folgende Implikationen:*

- (a) *Ist X_n separabel und metrisierbar für jedes $n \in \mathbb{N}$, so ist auch $\prod_{n=1}^\infty X_n$ mit der Produkttopologie separabel und metrisierbar.*
- (b) *Ist x_n polnisch für jedes $n \in \mathbb{N}$, so ist auch $\prod_{n=1}^\infty X_n$ mit der Produkttopologie polnisch.*

Beweis. Wir zeigen zunächst Aussage (a). Seien alle X_n separabel und metrisierbar. Nach Satz 2.13 bzw. Hilfssatz 2.14 existieren dann Einbettungen $\varphi_n: X_n \rightarrow H$, $n \in \mathbb{N}$. Nun ist aber

$$\prod_{n=1}^\infty X_n \cong \prod_{n=1}^\infty \varphi_n(X_n) \subseteq \prod_{n=1}^\infty H \cong H$$

und Satz 2.13 liefert, dass $\prod_{n=1}^{\infty} X_n$ separabel und metrisierbar ist.

Für Teilaufgabe (b) setzen wir zusätzlich alle X_n als polnisch voraus. Dann ist $\varphi_n(X_n)$ für jedes $n \in \mathbb{N}$ eine G_δ -Teilmenge von H , also existieren für alle $k, n \in \mathbb{N}$ derartige offene Mengen $U_n^{(k)} \subseteq H$, dass $\varphi_n(X_n) = \bigcap_{k \in \mathbb{N}} U_n^{(k)}$ ist. Da nun insbesondere auch

$$V_n^{(k)} := \left(\prod_{m=1}^{n-1} H \times U_n^{(k)} \times \prod_{m=n+1}^{\infty} H \right) \subseteq \prod_{n=1}^{\infty} H$$

für alle $k, n \in \mathbb{N}$ offen ist, folgt

$$\prod_{n=1}^{\infty} X_n \cong \prod_{n=1}^{\infty} \bigcap_{k \in \mathbb{N}} U_n^{(k)} = \bigcap_{n \in \mathbb{N}} \bigcap_{k \in \mathbb{N}} V_n^{(k)} \subseteq \prod_{n=1}^{\infty} H \cong H,$$

also ist $\prod_{n=1}^{\infty} X_n$ homöomorph zu einer G_δ -Teilmenge von H und damit nach Satz 2.13 polnisch. \square

Bemerkung. Insbesondere gelten die Aussagen aus Folgerung 2.15 auch für endliche Produkte, denn für alle übrigen $n \in \mathbb{N}$ können wir X_n in diesem Fall einfach als einen einzigen Punkt wählen.

2.3 Borel-Maße auf topologischen Räumen

Nun wenden wir uns (endlichen) Borel-Maßen auf topologischen bzw. metrischen Räumen zu. Da diese den primären Betrachtungsgegenstand der Arbeit darstellen, möchten wir zunächst einige Begriffe definieren, Schreibweisen festlegen, und - zumindest im Falle von metrischen Räumen - eine im Folgenden sehr hilfreiche Eigenschaft dieser Maße, die (*Schwache*) *Regularität* vorstellen.

Wieder werden wir uns an den relevanten Teilen von [Sim15, Kapitel 4.14] orientieren.

Definition 2.16 (Borel- σ -Algebra). *Sei X ein topologischer Raum mit Topologie \mathcal{O} . Dann definieren wir die Borel- σ -Algebra*

$$\mathcal{B}(X) = \mathcal{B} := \sigma(\mathcal{O})$$

als die kleinste σ -Algebra auf X , die \mathcal{O} umfasst.

Definition 2.17 (Borel-Maße). *In der Situation von Definition 2.16 nennen wir Maße auf $\mathcal{B}(X)$ Borel-Maße. Wir führen außerdem die Schreibweisen*

$$\begin{aligned} \mathcal{M}_+(X) &:= \{ \mu: \mathcal{B}(X) \rightarrow [0, \infty) \mid \mu \text{ ist endliches Maß} \} \\ \mathcal{P}(X) &:= \{ \mu: \mathcal{B}(X) \rightarrow [0, 1] \mid \mu \text{ ist Wahrscheinlichkeitsmaß} \} \end{aligned}$$

für die Menge aller endlichen Borel-Maße beziehungsweise Borel-Wahrscheinlichkeitsmaße auf X ein.

Definition 2.18 (Stetige beschränkte Funktionen). *Sei X ein topologischer Raum. Dann schreiben wir*

$$C_b(X) := \{ f: X \rightarrow \mathbb{R} \mid f \text{ ist stetig und beschränkt} \}$$

für die Menge aller stetigen und beschränkten Funktionen auf X . Ist X ein metrischer Raum, so schreiben wir außerdem

$$\begin{aligned} U_b(X) &:= \{ f: X \rightarrow \mathbb{R} \mid f \text{ ist gleichmäßig stetig und beschränkt} \} \quad \text{und} \\ \text{Lip}_b(X) &:= \{ f: X \rightarrow \mathbb{R} \mid f \text{ ist lipschitzstetig und beschränkt} \}. \end{aligned}$$

Bemerkung. Sei X ein metrischer Raum. Sicherlich ist dann $\text{Lip}_b(X) \subseteq U_b(X) \subseteq C_b(X)$, allerdings hängen $\text{Lip}_b(X)$ und $U_b(X)$ im Gegensatz zu $C_b(X)$ von der Metrik selbst und nicht ausschließlich von der Topologie ab.

Wie angekündigt werden wir uns im Folgenden mit der (schwachen) Regularität von endlichen Borel-Maßen auseinandersetzen. Hierbei handelt es sich um eine Approximationseigenschaft, die es uns etwa erlaubt, gewisse Aussagen zunächst für abgeschlossene bzw. kompakte und für offene Mengen zu zeigen, um diese anschließend auf ganz $\mathcal{B}(X)$ auszuweiten.

Definition 2.19 (Schwache Regularität von Maßen). Sei X ein topologischer Raum und μ ein endliches Borel-Maß auf X . Dann nennen wir $B \in \mathcal{B}(X)$ schwach von innen bzw. von außen regulär, falls

$$\mu(B) = \sup_{\substack{C \subseteq B \\ C \text{ abgeschlossen}}} \mu(C) \quad \text{bzw.} \quad \mu(B) = \inf_{\substack{U \supseteq B \\ U \text{ offen}}} \mu(U)$$

gelten. Wir nennen $B \in \mathcal{B}(X)$ schwach regulär, wenn B schwach von innen und von außen regulär ist. Sind alle $B \in \mathcal{B}(X)$ schwach regulär, so nennen wir μ ein schwach reguläres Maß.

Bemerkung. Ersetzen wir in der obigen Definition „abgeschlossen“ durch „kompakt“, so erhalten wir analog den Begriff der Regularität.

Offenbar ist eine abgeschlossene (bzw. offene) Menge schwach regulär von innen (bzw. außen).

Im Falle von endlichen Maßen auf metrischen Räumen kann schwache Regularität recht leicht gezeigt werden, wie wir im Folgenden sehen werden.

Satz 2.20. Ist (X, d) ein metrischer Raum, so ist jedes endliche Borel-Maß μ auf X schwach regulär.

Für den Beweis des Satzes benötigen wir noch einen Hilfssatz, welcher uns ermöglichen wird, die schwache Regularität nur auf einem Erzeuger von $\mathcal{B}(X)$ zu zeigen (für den wir dann die abgeschlossenen Mengen wählen).

Hilfssatz 2.21. In der Situation von Definition 2.19 ist

$$\mathcal{S} := \{ B \in \mathcal{B}(X) \mid B \text{ schwach regulär bzgl. } \mu \}$$

eine σ -Algebra.

Beweis. Wir stellen eine Anpassung des Beweises von [Sim15, Lemma 4.5.5] vor, wo die entsprechende Aussage mit „regulär“ anstelle „schwach regulär“ für kompakte X bewiesen wird.

Offensichtlich liegen \emptyset und X in \mathcal{S} . Sei $B \in \mathcal{S}$ und damit schwach regulär von innen und von außen. Wegen $\mu(X) < \infty$ gilt dann

$$\mu(B^c) = \mu(X) - \mu(B) = \mu(X) - \sup_{\substack{C \subseteq B \\ C^c \in \mathcal{O}}} \mu(C) = \inf_{\substack{C \subseteq B \\ C^c \in \mathcal{O}}} (\mu(X) - \mu(C)) = \inf_{\substack{U \supseteq B^c \\ U \in \mathcal{O}}} \mu(U)$$

sowie analog

$$\mu(B^c) = \mu(X) - \mu(B) = \mu(X) - \inf_{\substack{U \supseteq B \\ U \in \mathcal{O}}} \mu(U) = \sup_{\substack{U \supseteq B \\ U \in \mathcal{O}}} (\mu(X) - \mu(U)) = \sup_{\substack{C \subseteq B^c \\ C^c \in \mathcal{O}}} \mu(C).$$

Also ist auch B^c schwach regulär.

Es bleibt nun zu zeigen, dass für $(B_n)_n \in \mathcal{S}^{\mathbb{N}}$ auch $B := \bigcup_{n \in \mathbb{N}} B_n$ schwach regulär ist. Hierfür beweisen wir zunächst die schwache Regularität von innen. Sei dazu $\varepsilon > 0$. Für $n \in \mathbb{N}$ gibt es jeweils abgeschlossene Mengen $C_n \subseteq B_n$ mit $\mu(B_n) - \mu(C_n) < \frac{\varepsilon}{3^n}$. Wir wählen nun N so groß, dass $\mu\left(B \setminus \bigcup_{n=1}^N B_n\right) < \frac{\varepsilon}{2}$ ist (was wegen $\mu(B) < \infty$ immer geht). Für die abgeschlossene Menge $C := \bigcup_{n=1}^N C_k$ gilt dann die Ungleichung

$$\begin{aligned} \mu(B) - \mu(C) &= \mu(B \setminus C) = \mu\left(\left(B \setminus \bigcup_{n=1}^N B_n\right) \cup \left(\bigcup_{n=1}^N B_n \setminus C\right)\right) \\ &\leq \mu\left(B \setminus \bigcup_{n=1}^N B_n\right) + \sum_{n=1}^N \mu(B_n \setminus C_n) \\ &< \frac{\varepsilon}{2} + \sum_{n=1}^{\infty} \frac{\varepsilon}{3^n} = \varepsilon, \end{aligned}$$

also ist B schwach regulär von innen.

Ferner existieren für alle n offene Mengen $U_n \supseteq B_n$ mit $\mu(U_n) - \mu(B_n) < \frac{\varepsilon}{2^n}$. Wir setzen $U := \bigcup_{n \in \mathbb{N}} U_n$ und berechnen

$$\mu(U) - \mu(B) \leq \sum_{n=1}^{\infty} \mu(U_n \setminus B) \leq \sum_{n=1}^{\infty} \mu(U_n \setminus B_n) < \varepsilon.$$

Weil U offen ist, folgt insgesamt die schwache Regularität von μ . \square

Ausgestattet mit den Hilfssätzen 2.9 und 2.21 kann nun, wie oben bereits angedeutet wurde, Satz 2.20 bewiesen werden.

Beweis von Satz 2.20. Es ist nun zu zeigen, dass für jedes endliche Borel-Maß μ auf X die Menge

$$\mathcal{S} := \{ B \in \mathcal{B}(X) \mid B \text{ schwach regulär bzgl. } \mu \}$$

bereits ganz $\mathcal{B}(X)$ ist. Da \mathcal{S} nach Hilfssatz 2.21 eine σ -Algebra ist und $\mathcal{B}(X)$ von den abgeschlossenen Mengen erzeugt wird, genügt es zu zeigen, dass diese in \mathcal{S} enthalten sind.

Sei $C \in \mathcal{B}(X)$. Dann ist C sicherlich schwach regulär von innen. Nun verwenden wir die offenen Mengen A_n , $n \in \mathbb{N}$ aus Hilfssatz 2.9. Wegen $A_n \downarrow C$ und $\mu(X) < \infty$ folgt mit der Maßstetigkeit von oben die Konvergenz $\mu(A_n) \downarrow \mu(C)$, sodass C auch schwach regulär von außen ist. \square

Bemerkung. Handelt es sich in der Situation von Satz 2.20 bei X um einen polnischen Raum, so werden wir zu einem späteren Zeitpunkt (in Folgerung 5.3) noch sehen, dass hier tatsächlich sogar Regularität gilt.

Schließlich möchten wir noch kurz eine direkte Folgerung aus Satz 2.20 vorstellen, die etwas schwächere hinreichende Bedingungen für die Gleichheit zweier endlicher Maße auf metrischen Räumen bereitstellt. Im weiteren Verlauf wird sich dies noch als nützlich erweisen.

Satz 2.22. Sei (X, d) ein metrischer Raum und seien $\mu, \nu \in \mathcal{M}_+(X)$. Dann sind die folgenden Aussagen äquivalent:

- (i) $\mu = \nu$.
- (ii) Für alle $f \in U_b(X)$ ist $\int f d\mu = \int f d\nu$.
- (iii) Für alle abgeschlossenen Mengen $C \subseteq X$ ist $\mu(C) = \nu(C)$.

Beweis. Die Implikation (i) \Rightarrow (ii) ist klar und (iii) \Rightarrow (i) folgt aus Satz 2.20.

(ii) \Rightarrow (iii): Gelte (ii) und sei $C \subseteq X$ abgeschlossen. Dann gilt für die Funktionen $f_n \in U_b(X)$ aus Hilfssatz 2.9

$$\int f_n \, d\mu = \int f_n \, d\nu, \quad n \in \mathbb{N}.$$

Wegen $|f_n| \leq 1$ und $f_n \downarrow \mathbb{1}_C$ folgt mit dem Satz von Lebesgue

$$\int f_n \, d\mu \rightarrow \mu(C) \quad \text{und} \quad \int f_n \, d\nu \rightarrow \nu(C)$$

und damit gilt (iii). □

3 Schwache Topologie und schwache Konvergenz

In diesem Kapitel werden wir endliche Borel-Maße auf topologischen Räumen selbst mit einer Topologie bzw. einem Konvergenzbegriff versehen, dem der sogenannten *schwachen Konvergenz*. Diese verallgemeinert die aus der Stochastik bekannte *Verteilungskonvergenz* auf allgemeinere Räume als \mathbb{R} . Erst die Einschränkung auf speziellere Klassen topologischer Räume als Grundraum (wie etwa polnische Räume) wird uns einige nicht-triviale Erkenntnisse über die Topologie dieses Raumes der Wahrscheinlichkeitsmaße ermöglichen.

Die grundlegenden Definitionen und Bemerkungen in den Abschnitten 3.1 und 3.2 folgen [Vee58, Abschnitte 1-3], während wir uns beim Beweis von Satz 3.5 in Abschnitt 3.3 an [Sim15, Satz 4.14.4] orientieren.

3.1 Definitionen

Definition 3.1 (Schwache Topologie). *Sei X ein topologischer Raum. Dann ist die schwache Topologie auf $\mathcal{M}_+(X)$ definiert als die Initialtopologie bezüglich der Abbildungen*

$$I_f: \mathcal{M}_+(X) \rightarrow \mathbb{R}, \mu \mapsto \int f d\mu, \quad f \in C_b(X).$$

Falls nicht explizit angegeben, sei $\mathcal{M}_+(X)$ im Folgenden immer mit der schwachen Topologie versehen.

Definition 3.2 (Schwache Konvergenz von Maßen). *In der Situation von Definition 3.1 heißt ein Netz $(\mu_\iota)_{\iota \in I}$ von Maßen in $\mathcal{M}_+(X)$ genau dann schwach konvergent gegen ein Maß $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$, wenn $\lim_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota = \mu$ bezüglich der schwachen Topologie gilt. In diesem Fall schreiben wir auch*

$$\mu_\iota \xrightarrow{w} \mu.$$

Hilfssatz 3.3. *Sei X ein topologischer Raum. Ein Netz $(\mu_\iota)_{\iota \in I}$ in $\mathcal{M}_+(X)$ konvergiert genau dann schwach gegen $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$, wenn*

$$\lim_{\iota \rightarrow \infty} \int f d\mu_\iota = \int f d\mu$$

für alle $f \in C_b(X)$ gilt.

Beweis. Dies folgt direkt aus Hilfssatz 2.7. □

Bemerkung. *Häufig betrachten wir nur Teilräume von $\mathcal{M}_+(X)$ wie etwa $\mathcal{P}(X)$. Mit der schwachen Topologie auf solchen Teilräumen bezeichnen wir dann einfach die entsprechende Teilraumtopologie. Damit behält Hilfssatz 3.3 offenbar auch seine Gültigkeit, wenn man $\mathcal{M}_+(X)$ durch den jeweiligen Teilraum ersetzt.*

3.2 Beziehung zur Schwach-*-Konvergenz

Angesichts des Namens der *schwachen Konvergenz* bzw. *schwachen Topologie* stellt sich unmittelbar die Frage, ob diese in irgendeiner Beziehung zur schwachen Konvergenz bzw. schwachen Topologie in Banachräumen aus der Funktionalanalysis steht. Tatsächlich handelt es sich eher um eine Art von Schwach-*-Konvergenz, wie wir im Folgenden sehen werden.

Sei dazu zunächst X ein topologischer Raum. Dann ist $(C_b(X), \|\cdot\|_\infty)$ ein normierter Vektorraum und wir betrachten nun die Abbildung

$$\Phi: \mathcal{M}_+(X) \rightarrow C_b(X)^*, \mu \mapsto \left[l_\mu: C_b(X) \rightarrow \mathbb{R}, f \mapsto \int f d\mu \right], \quad (3.1)$$

die wegen $|\int f d\mu| \leq \mu(X) \|f\|_\infty$ und $\mu(X) < \infty$ wohldefiniert ist und einem endlichen Maß $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$ ein zugehöriges lineares Funktional aus dem Dualraum $C_b(X)^*$ von $C_b(X)$ zuordnet. Ist $C_b(X)^*$ mit der Schwach-*-Topologie ausgestattet, so entspricht schwache Konvergenz in $\mathcal{M}_+(X)$ trivialerweise der Schwach-*-Konvergenz der jeweiligen Bilder unter Φ .

Ist X etwa metrisierbar, so können wir sogar noch eine stärkere Aussage formulieren:

Hilfssatz 3.4. *Sei X ein metrisierbarer topologischer Raum. Dann ist die Abbildung Φ aus (3.1) ein Homöomorphismus auf sein Bild.*

Beweis. Φ ist injektiv, denn für $\mu, \nu \in \mathcal{M}_+(X)$ folgt aus $l_\mu = l_\nu$ wegen Satz 2.22 die Gleichheit $\mu = \nu$. Da schwache Konvergenz in $\mathcal{M}_+(X)$ exakt der Schwach-*-Konvergenz der jeweiligen Bilder unter Φ entspricht, liefert Satz 2.4 die Behauptung. \square

Unter obigen Voraussetzungen lässt sich $\mathcal{M}_+(X)$ also in $C_b(X)^*$ einbetten. Mittels dieser Identifikation können nun Aussagen aus der Funktionalanalysis auch für $\mathcal{M}_+(X)$ fruchtbar gemacht werden, indem von topologischen Eigenschaften von $C_b(X)^*$ mit der Schwach-*-Konvergenz auf die entsprechenden Eigenschaften von $\mathcal{M}_+(X)$ geschlossen wird. Konkrete Anwendungen hiervon werden wir bereits in Abschnitt 4 sehen.

3.3 Charakterisierungen schwacher Konvergenz

Im Falle metrisierbarer topologischer Räume liefert der folgende Satz eine umfassende Charakterisierung der schwachen Konvergenz.

Satz 3.5 (Portmanteau). *Sei (X, d) ein metrischer Raum, $(\mu_\iota)_{\iota \in I}$ ein Netz in $\mathcal{M}_+(X)$ und $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$. Dann sind die folgenden Aussagen äquivalent:*

- (i) $\mu_\iota \xrightarrow{w} \mu$.
- (ii) Für alle $f \in U_b(X)$ gilt $\lim_{\iota \rightarrow \infty} \int f d\mu_\iota = \int f d\mu$.
- (iii) Für alle $f \in \text{Lip}_b(X)$ gilt $\lim_{\iota \rightarrow \infty} \int f d\mu_\iota = \int f d\mu$.
- (iv) Es ist $\lim_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(X) = \mu(X)$ und für alle abgeschlossenen Mengen $C \subseteq X$ gilt

$$\limsup_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(C) \leq \mu(C).$$

- (v) Es ist $\lim_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(X) = \mu(X)$ und für alle offenen Mengen $U \subseteq X$ gilt

$$\liminf_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(U) \geq \mu(U).$$

- (vi) Für alle $B \in \mathcal{B}(X)$ mit $\mu(\partial B) = 0$ ist

$$\lim_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(A) = \mu(A).$$

Beweis. Wir präsentieren hier eine Verallgemeinerung des Beweises von Satz 4.14.4 in [Sim15, Kapitel 4.14] mit endlichen Maßen anstelle von Wahrscheinlichkeitsmaßen und Netzen anstelle von Folgen. Die Implikationen „(i) \Rightarrow (ii) \Rightarrow (iii)“ folgen direkt aus Hilfssatz 3.3.

(iii) \Rightarrow (iv): Sei $C \subseteq X$ abgeschlossen und seien f_m , $m \in \mathbb{N}$ die Funktionen aus Hilfssatz 2.9. Diese sind lipschitzstetig und beschränkt. Dann gilt für alle $m \in \mathbb{N}$

$$\mu_\iota(C) = \int \mathbf{1}_C d\mu_\iota \leq \int f_m d\mu_\iota \rightarrow \int f_m d\mu, \quad \iota \rightarrow \infty,$$

also

$$\limsup_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(C) \leq \int f_m d\mu.$$

Wegen $f_m \downarrow \mathbb{1}_C$ und $|f_m| \leq 1$ liefert der Satz von Lebesgue die Konvergenz

$$\int f_m d\mu \rightarrow \int \mathbb{1}_C d\mu = \mu(C), \quad m \rightarrow \infty,$$

woraus

$$\limsup_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(C) \leq \mu(C)$$

folgt. Außerdem ist

$$\mu_\iota(X) = \int \mathbb{1}_X d\mu_\iota \rightarrow \int \mathbb{1}_X d\mu = \mu(X), \quad \iota \rightarrow \infty.$$

(iv) \Leftrightarrow (v): Es gelte (iv). Sei U offen, also $C := U^c$ abgeschlossen. Dann erhalten wir

$$\begin{aligned} \liminf_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(U) &= \liminf_{\iota \rightarrow \infty} (\mu_\iota(X) - \mu_\iota(C)) = \mu(X) - \limsup_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(C) \\ &\geq \mu(X) - \mu(C) = \mu(U) \end{aligned}$$

und damit (v). Die andere Richtung zeigt man analog.

(iv), (v) \Rightarrow (vi): Sei $A \in \mathcal{B}(X)$ mit $\mu(\partial A) = 0$. Wegen $A^\circ \subseteq A \subseteq \overline{A}$ und $\partial A = \overline{A} \setminus A^\circ$ gilt $\mu(A^\circ) = \mu(A) = \mu(\overline{A})$. Ferner liefern die Annahmen

$$\limsup_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(\overline{A}) \leq \mu(\overline{A}) \quad \text{und} \quad \liminf_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(A^\circ) \geq \mu(A^\circ).$$

Daraus folgt

$$\limsup_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(A) \leq \mu(A) \leq \liminf_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(A),$$

also insgesamt

$$\lim_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(A) = \mu(A).$$

(vi) \Rightarrow (i): Sei $f \in C_b(X)$ und $a < b \in \mathbb{R}$ mit $a < f < b$. Die Menge

$$S := \{c \in (a, b) \mid \mu(\{f = c\}) > 0\},$$

ist abzählbar, da $S_n := \{c \in (a, b) \mid \mu(\{f = c\}) > \frac{1}{n}\}$ für jedes $n \in \mathbb{N}$ endlich ist und $S = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} S_n$ gilt. Damit können wir für jedes $m \in \mathbb{N}$ Zahlen $c_j^{(m)} \notin S$ mit

$$a = c_0^{(m)} < \dots < c_{2m}^{(m)} = b, \quad c_{j+1}^{(m)} - c_j^{(m)} \leq \frac{b-a}{m} \quad (3.2)$$

finden. Wir setzen

$$A_j^{(m)} := \{c_j^{(m)} < f \leq c_{j+1}^{(m)}\}, \quad j \in \{0, \dots, 2m-1\}.$$

Die Stetigkeit von f impliziert $\partial A_j^{(m)} \subseteq \{f = c_j^{(m)}\} \cup \{f = c_{j+1}^{(m)}\}$, woraus sich

$$\mu(\partial A_j^{(m)}) = 0, \quad j \in \{0, \dots, 2m-1\}$$

ergibt. Für $m \in \mathbb{N}$ schreiben wir

$$u_m := \sum_{j=0}^{2m-1} c_j^{(m)} \mathbb{1}_{A_j^{(m)}}$$

und Aussage (v) führt dann auf

$$\int u_m \, d\mu_\iota = \sum_{j=0}^{2m-1} c_j^{(m)} \mu_\iota(A_j^{(m)}) \rightarrow \sum_{j=0}^{2m-1} c_j^{(m)} \mu(A_j^{(m)}) = \int u_m \, d\mu, \quad \iota \rightarrow \infty. \quad (3.3)$$

Außerdem folgen aus (3.2) die Ungleichungen

$$\left| \int f \, d\mu_\iota - \int u_m \, d\mu_\iota \right| \leq \frac{b-a}{m}, \quad \left| \int f \, d\mu - \int u_m \, d\mu \right| \leq \frac{b-a}{m} \quad (3.4)$$

für $\iota \in I$. Mit (3.4) gilt nun für alle $m \in \mathbb{N}$, $\iota \in I$

$$\begin{aligned} \left| \int f \, d\mu - \int f \, d\mu_\iota \right| &\leq \left| \int f \, d\mu - \int u_m \, d\mu \right| + \left| \int u_m \, d\mu - \int u_m \, d\mu_\iota \right| \\ &\quad + \left| \int u_m \, d\mu_\iota - \int f \, d\mu_\iota \right| \\ &\leq 2 \cdot \frac{b-a}{m} + \left| \int u_m \, d\mu_\iota - \int u_m \, d\mu \right|. \end{aligned} \quad (3.5)$$

(3.3) und (3.5) liefern also letztendlich für alle m

$$\begin{aligned} \limsup_{\iota \rightarrow \infty} \left| \int f \, d\mu - \int f \, d\mu_\iota \right| &\leq 2 \cdot \frac{b-a}{m} + \limsup_{\iota \rightarrow \infty} \left| \int u_m \, d\mu_\iota - \int u_m \, d\mu \right| \\ &= 2 \cdot \frac{b-a}{m} \rightarrow 0, \quad m \rightarrow \infty, \end{aligned}$$

was wegen Hilfssatz 3.3 die schwache Konvergenz $\mu_\iota \xrightarrow{w} \mu$ impliziert. \square

Bemerkung (Verteilungskonvergenz). *Betrachte den Fall $X := \mathbb{R}$. Sei nun $(\mathbb{P}_n)_n \in \mathcal{P}(\mathbb{R})^{\mathbb{N}}$, $\mathbb{P} \in \mathcal{P}(\mathbb{R})$ und seien $F_n: \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$, $x \mapsto \mathbb{P}_n((-\infty, x])$, $F: \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$, $x \mapsto \mathbb{P}((-\infty, x])$ die zugehörigen Verteilungsfunktionen. In der Stochastik spricht man davon, dass $(\mathbb{P}_n)_n$ in Verteilung gegen \mathbb{P} konvergiert, falls*

$$\lim_{n \rightarrow \infty} F_n(x) = F(x)$$

für alle $x \in \mathbb{R}$ gilt, in denen F stetig ist [Hen16, Definition 6.1].

Tatsächlich ist die Verteilungskonvergenz von $(\mathbb{P}_n)_n$ gegen \mathbb{P} gerade äquivalent zur schwachen Konvergenz $\mathbb{P}_n \xrightarrow{w} \mathbb{P}$. Dies lässt sich analog zur Äquivalenz (i) \Leftrightarrow (vi) in Satz 3.5 beweisen, wobei für den Beweis der Rückrichtung passende Intervalle als $A_j^{(m)}$ verwendet werden müssen.

4 Eigenschaften der schwachen Topologie

Nachdem wir im vorigen Abschnitt die schwache Topologie definiert haben, möchten wir uns nun einige Eigenschaften dieser ansehen, wenn man weitere Bedingungen an den Grundraum X stellt. Als Grundbedingung möchten wir in diesem Abschnitt immer die Metrisierbarkeit von X fordern. Unter dieser Voraussetzung werden die folgenden Aussagen unsere zentralen Erkenntnisse sein:

- $\mathcal{M}_+(X)$ ist genau dann metrisierbar und separabel, wenn X separabel ist.
- $\mathcal{M}_+(X)$ ist genau dann polnisch, wenn X polnisch ist.
- $\mathcal{P}(X)$ ist genau dann metrisierbar und kompakt, wenn X kompakt ist.

Abgesehen von Satz 4.8, bei dem wir im Wesentlichen [van03] folgen, orientieren wir uns in diesem Abschnitt an [Vee58].

Im Folgenden Satz stellen wir zunächst eine Möglichkeit vor, X in $\mathcal{M}_+(X)$ einzubetten.

Satz 4.1. *Sei X ein metrisierbarer topologischer Raum. Für $x \in X$ schreiben wir $\delta_x \in \mathcal{P}(X)$ für das Dirac-Maß im Punkt x und definieren*

$$\delta: X \rightarrow \mathcal{M}_+(X), x \mapsto \delta_x.$$

Außerdem setzen wir $\Delta := \delta(X) = \{ \delta_x \mid x \in X \}$. Dann gelten die folgenden Aussagen:

- δ ist ein Homöomorphismus zwischen X und Δ .
- $\Delta \subseteq \mathcal{M}_+(X)$ ist sequentiell abgeschlossen.

Beweis. Wir beweisen zunächst Aussage (a). Weil X metrisierbar ist und die einelementigen Mengen $\{x\}$, $x \in X$ daher in $\mathcal{B}(X)$ enthalten sind, ist δ sicherlich injektiv. Wegen Satz 2.4 (b) genügt es also nachzuweisen, dass für jedes Netz $(x_\iota)_{\iota \in I}$ in X sowie $z \in X$ die Äquivalenz

$$x_\iota \rightarrow z \iff \delta_{x_\iota} \xrightarrow{w} \delta_z, \quad \iota \rightarrow \infty$$

gilt.

Sei $(x_\iota)_{\iota \in I}$ ein Netz in X , das gegen $z \in X$ konvergiert und sei $f \in C_b(X)$. Dann ist

$$\int f d\delta_{x_\iota} = f(x_\iota) \rightarrow f(z) = \int f d\delta_z, \quad \iota \rightarrow \infty,$$

also konvergiert δ_{x_ι} schwach gegen δ_z . Gelte umgekehrt $\delta_{x_\iota} \xrightarrow{w} \delta_z$. Wähle eine Metrik d , die X metrisiert und setze $f := \min(1, d(\cdot, z)) \in C_b(X)$. Dann ist

$$\min(1, d(x_\iota, z)) = \int f d\delta_{x_\iota} \rightarrow \int f d\delta_z = 0,$$

was $x_\iota \rightarrow z$ nach sich zieht.

Nun möchten wir Aussage (b) zeigen. Sei $(x_n)_n \in X^{\mathbb{N}}$ und sei $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$ mit $\delta_{x_n} \xrightarrow{w} \mu$, $n \rightarrow \infty$. Zunächst gilt sicherlich $\mu \in \mathcal{P}(X)$. Außerdem muss $(x_n)_n$ eine konvergente Teilfolge besitzen. Ansonsten ist nämlich $S := \{x_n \mid n \in \mathbb{N}\} \subseteq X$ eine unendliche und abgeschlossene Teilmenge. Das Portmanteau-Theorem (Satz 3.5) liefert also für jede unendliche Teilmenge $\tilde{S} \subseteq S$ die Abschätzung

$$1 = \limsup_{n \rightarrow \infty} \delta_{x_n}(\tilde{S}) \leq \mu(\tilde{S}) \leq 1,$$

was einen Widerspruch darstellt. Also existiert eine Teilfolge $(x_{n_k})_k$ und $x \in X$ mit $x_{n_k} \rightarrow x$, $k \rightarrow \infty$. Damit ist aber auch $\delta_{x_{n_k}} \xrightarrow{w} \delta_x$, weshalb mit Satz 2.22 die Gleichheit $\mu = \delta_x \in \Delta$ folgt. \square

Nun wenden wir uns den angekündigten zentralen Aussagen dieses Abschnittes zu.

Satz 4.2. *Sei X ein metrisierbarer topologischer Raum. Dann ist $\mathcal{M}_+(X)$ genau dann metrisierbar und separabel, wenn X separabel ist.*

Für den Beweis benötigen wir zunächst noch einige wenige Hilfssätze, die wir im Folgenden vorstellen möchten.

Hilfssatz 4.3. *Sei X ein metrisierbarer topologischer Raum. Dann ist $(C_b(X), \|\cdot\|_\infty)$ ein Banachraum. Ist X kompakt, so ist $C_b(X)$ separabel.*

Beweis. Sicherlich ist $(C_b(X), \|\cdot\|_\infty)$ ein normierter Vektorraum. Siehe [Sim15, Satz 2.1.6] für die Vollständigkeit und [Sim15, Satz 2.3.7] für die Separabilität bei kompaktem X . \square

Hilfssatz 4.4. *Sei (X, d) ein totalbeschränkter metrischer Raum. Dann ist $U_b(X)$ ein separabler Banachraum.*

Beweis. Sei \tilde{X} die Vervollständigung von X . Diese ist kompakt und damit ist $C_b(\tilde{X})$ nach Hilfssatz 4.3 ein separabler Banachraum. Jedes $f \in U_b(X)$ besitzt eine eindeutige Fortsetzung $\tilde{f} \in C_b(\tilde{X})$ mit $\|f\|_\infty = \|\tilde{f}\|_\infty$. Damit wird über die Zuordnung

$$E: U_b(X) \rightarrow C_b(\tilde{X}), f \mapsto \tilde{f}$$

eine isometrische Einbettung von $U_b(X)$ nach $C_b(\tilde{X})$ definiert. Wegen $C_b(\tilde{X}) = U_b(\tilde{X})$ (vgl. [Sim15, Satz 2.3.10]) ist $g|_X \in U_b(X)$ für alle $g \in C_b(\tilde{X})$ und damit auch $g = E(g|_X)$. Also ist E surjektiv und damit eine Isometrie zwischen $U_b(X)$ und $C_b(\tilde{X})$. Hilfssatz 4.3 liefert nun die Behauptung. \square

Hilfssatz 4.5. *Sei $R := \mathbb{R}^{\mathbb{N}}$ ausgestattet mit der Produkttopologie von \mathbb{R} , also mit der Initialtopologie der Projektionen $\pi_k: R \rightarrow \mathbb{R}$, $x = (x_n)_n \mapsto x_k$, $k \in \mathbb{N}$. Dann ist R polnisch.*

Beweis.

$$R \cong (0, 1)^{\mathbb{N}} = \bigcap_{n \in \mathbb{N}} \left(\prod_{k=1}^n (0, 1) \times \prod_{k=n+1}^{\infty} [0, 1] \right)$$

ist homöomorph zu einer G_δ -Teilmenge des Hilbertwürfels H , worauf mit Satz 2.13 unmittelbar die Behauptung folgt. \square

Ausgestattet mit den obigen Hilfssätzen können wir nun zum Beweis von Satz 4.2 übergehen. Im Wesentlichen werden wir eine Einbettung von $\mathcal{M}_+(X)$ nach R konstruieren, die uns unmittelbar die Behauptung liefert.

Beweis von Satz 4.2. Für die Hinrichtung fixieren wir auf X eine Metrik d , die X metrisiert. Nach Hilfssatz 2.14 existiert dann ein Homöomorphismus $\varphi: X \rightarrow H$ von X auf eine Teilmenge $\varphi(X)$ des Hilbertwürfels H . Wir wählen nun die Metrik ρ aus Hilfssatz 2.12 auf H . Aufgrund der Kompaktheit von H ist (H, ρ) totalbeschränkt und damit auch jede Teilmenge von H . Also können wir über ρ eine Metrik \tilde{d} auf X einführen, sodass X von \tilde{d} metrisiert wird und (X, \tilde{d}) totalbeschränkt ist. Im Folgenden sei auf X diese Metrik fixiert. Hilfssatz 4.4 liefert uns, dass $(U_b(X), \|\cdot\|_\infty)$ ein separabler Banachraum ist. Sei nun $\mathcal{D} := \{f_n \mid n \in \mathbb{N}\} \subseteq U_b(X)$ eine abzählbare dichte Teilmenge, die wir so wählen, dass $f_1 = \mathbb{1}_X$ ist.

Wir setzen

$$T: \mathcal{M}_+(X) \rightarrow R, \mu \mapsto \left(\int f_n d\mu \right)_n \quad (4.1)$$

und möchten nachweisen, dass T ein Homöomorphismus auf sein Bild ist. Da R nach Hilfssatz 4.5 separabel und metrisierbar ist, übertragen sich diese Eigenschaften dann auch auf $\mathcal{M}_+(X)$.

Wir zeigen zunächst die Injektivität. Seien dazu $\mu, \nu \in \mathcal{M}_+(X)$ mit $T(\mu) = T(\nu)$. Sei außerdem $g \in U_b(X)$. Dann gibt es eine Folge $(g_n)_n \in \mathcal{D}^{\mathbb{N}}$ mit $\|g - g_n\|_{\infty} \rightarrow 0$, $n \rightarrow \infty$, was auch

$$\int g_n d\mu \rightarrow \int g d\mu \quad \text{und} \quad \int g_n d\nu \rightarrow \int g d\nu, \quad n \rightarrow \infty$$

impliziert. Da aber $\int g_n d\mu = \int g_n d\nu$ für alle $n \in \mathbb{N}$ gilt, folgt auch $\int g d\mu = \int g d\nu$. Satz 2.22 liefert nun die Gleichheit $\mu = \nu$.

Um den Beweis der Hinrichtung abzuschließen, genügt es wegen Satz 2.4 zu beweisen, dass für jedes Netz $(\mu_{\iota})_{\iota \in I}$ in $\mathcal{M}_+(X)$ und $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$ die Äquivalenz

$$\mu_{\iota} \xrightarrow{w} \mu \quad \Longleftrightarrow \quad T(\mu_{\iota}) \rightarrow T(\mu), \quad \iota \rightarrow \infty$$

gilt.

Gelte $\mu_{\iota} \xrightarrow{w} \mu$, was nach Satz 3.5 äquivalent dazu ist, dass $\lim_{\iota \rightarrow \infty} \int f d\mu_{\iota} = \int f d\mu$ für alle $f \in U_b(X)$ ist. Offenbar impliziert dies die Konvergenz $T(\mu_{\iota}) \rightarrow T(\mu)$, $\iota \rightarrow \infty$.

Sei nun umgekehrt $T(\mu_{\iota}) \rightarrow T(\mu)$, $\iota \rightarrow \infty$, was gleichbedeutend damit ist, dass

$$\lim_{\iota \rightarrow \infty} \int f_n d\mu_{\iota} = \int f_n d\mu \tag{4.2}$$

für alle $n \in \mathbb{N}$ gilt. Wegen $f_1 = \mathbf{1}_X$ gilt auch

$$\mu_{\iota}(X) = \int \mathbf{1}_X d\mu_{\iota} \rightarrow \int \mathbf{1}_X d\mu = \mu(X), \quad \iota \rightarrow \infty$$

und damit können wir eine Konstante $C < \infty$ und ein $\iota_0 \in I$ finden, sodass $\mu_{\iota}(X) \leq C$ für alle $\iota_0 \preceq \iota$ ist. Sei $g \in U_b(X)$ fest aber beliebig. Dann gibt es eine Folge $(g_n)_n \in \mathcal{D}^{\mathbb{N}}$ mit $\|g - g_n\|_{\infty} \rightarrow 0$, $n \rightarrow \infty$ und für jedes $n \in \mathbb{N}$, $\iota_0 \preceq \iota$ folgt

$$\begin{aligned} \left| \int g d\mu_{\iota} - \int g d\mu \right| &\leq \left| \int g d\mu_{\iota} - \int g_n d\mu_{\iota} \right| + \left| \int g_n d\mu_{\iota} - \int g_n d\mu \right| \\ &\quad + \left| \int g_n d\mu - \int g d\mu \right| \\ &\leq 2C \|g - g_n\|_{\infty} + \left| \int g_n d\mu_{\iota} - \int g_n d\mu \right|, \end{aligned}$$

was schließlich mit (4.2) auf

$$\limsup_{\iota \rightarrow \infty} \left| \int g d\mu_{\iota} - \int g d\mu \right| \leq 2C \|g - g_n\|_{\infty} \rightarrow 0, \quad n \rightarrow \infty$$

führt. Damit gilt

$$\int g d\mu_{\iota} \rightarrow \int g d\mu, \quad \iota \rightarrow \infty$$

für alle $g \in U_b(X)$, was nach Satz 3.5 die schwache Konvergenz $\mu_{\iota} \xrightarrow{w} \mu$, $\iota \rightarrow \infty$ impliziert.

Die Rückrichtung folgt direkt aus Satz 4.1, da die Metrisierbarkeit und Separabilität von $\mathcal{M}_+(X)$ direkt auch die Separabilität von $X \cong \Delta \subseteq \mathcal{M}_+(X)$ nach sich zieht. \square

Wir werden uns nun der zweiten Aussage vom Beginn dieses Abschnittes widmen.

Satz 4.6. *Sei X ein metrisierbarer topologischer Raum. Dann ist $\mathcal{M}_+(X)$ genau dann polnisch, wenn X polnisch ist.*

Für die Hinrichtung zeigen wir in einem Hilfssatz zunächst den wichtigen Spezialfall, dass der Grundraum X kompakt ist und weiten dies anschließend auf die Klasse aller polnischen Räume aus.

Hilfssatz 4.7. *Sei X ein kompakter metrisierbarer topologischer Raum. Dann ist $\mathcal{M}_+(X)$ polnisch.*

Beweis. Wir wählen zunächst eine Metrik d , die X vollständig metrisiert. Da X insbesondere separabel ist, können wir zunächst genau wie im Beweis von Satz 4.2 verfahren (abgesehen davon, dass wir anstelle von \tilde{d} direkt mit d arbeiten). Es sei außerdem angemerkt, dass nach [Sim15, Satz 2.3.10] aus der Kompaktheit von X die Gleichheit $C_b(X) = U_b(X)$ folgt. Da $C_b(X)$ nach Hilfssatz 4.3 separabel ist, existieren abzählbare dichte Teilmengen $\mathcal{D}_1 \subseteq C_b(X)$ und $\mathcal{D}_2 \subseteq \{f \in C_b(X) \mid f \geq 0\}$. Setzen wir

$$\mathcal{D} := \{f_n \mid n \in \mathbb{N}\} := \{\mathbb{1}_X\} \cup \mathcal{D}_1 \cup \mathcal{D}_2,$$

so erhalten wir also wieder die Abbildung

$$T: \mathcal{M}_+(X) \rightarrow R, \mu \mapsto \left(\int f_n d\mu \right)_n,$$

die ein Homöomorphismus auf ihr Bild ist.

Nun möchten wir nachweisen, dass $T(\mathcal{M}_+(X)) \subseteq R$ abgeschlossen ist, was uns sofort die Behauptung liefert, denn R ist nach Hilfssatz 4.5 selbst polnisch.

Wir verwenden die Charakterisierung von Abgeschlossenheit durch Netze aus Satz 2.4 (a). Ist $(\mu_\iota)_{\iota \in I}$ ein Netz in $\mathcal{M}_+(X)$ mit $T(\mu_\iota) \rightarrow r$, $\iota \rightarrow \infty$ für ein $r = (r_n)_n \in R$, so müssen wir zeigen, dass r in $T(\mathcal{M}_+(X))$ enthalten ist. Sicherlich gilt $r_n = \lim_{\iota \rightarrow \infty} \int f_n d\mu_\iota$ für alle $n \in \mathbb{N}$ und analog zum Beweis von Satz 4.2 können wir wieder eine Konstante $C < \infty$ und ein $\iota_0 \in I$ finden, sodass $\mu_\iota(X) \leq C$ für alle $\iota_0 \preceq \iota$ ist.

Wir setzen nun $A := \text{span}_{\mathbb{R}} \mathcal{D}$, was ein dichter Untervektorraum von $C_b(X)$ ist. Auf A definieren wir

$$l: A \rightarrow \mathbb{R}, f \mapsto \lim_{\iota \rightarrow \infty} \int f d\mu_\iota.$$

Offenbar ist l wohldefiniert und linear. Da $l(f) \leq C \|f\|_\infty$ für alle $f \in C_b(X)$ gilt, folgt $l \in A^*$. Nach dem Satz von Hahn-Banach (vgl. [Sim15, Folgerung 5.5.2]) existiert nun eine (eindeutige) Fortsetzung von l auf ganz $C_b(X)$, die wir ab jetzt l nennen. Es ist $l \in C_b(X)^*$ mit $\|l\|_{C_b(X)^*} = \|l\|_{A^*}$. Offenbar gilt $l(f) \geq 0$ für alle $f \in C_b(X)$ mit $f \geq 0$ und damit gibt es nach dem Darstellungssatz von Riesz-Markov (vgl. [Sim15, Satz 4.8.8]) ein Maß $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$ mit

$$l(f) = \int f d\mu, \quad f \in U_b(X).$$

Also folgt

$$\lim_{\iota \rightarrow \infty} \int f_n d\mu_\iota = r_n = l(f_n) = \int f_n d\mu.$$

für alle $n \in \mathbb{N}$. In völliger Analogie zum Beweis von Satz 4.2 folgt nun die schwache Konvergenz $\mu_\iota \xrightarrow{w} \mu$, $\iota \rightarrow \infty$, die wiederum $T(\mu_\iota) \rightarrow T(\mu)$ impliziert. Demnach ist $r = T(\mu) \in T(\mathcal{M}_+(X))$ und insgesamt haben wir gezeigt, dass $T(\mathcal{M}_+(X)) \subseteq R$ abgeschlossen ist. \square

Beweis von Satz 4.6. Wir widmen uns zunächst der Hinrichtung des Beweises. Analog zum Beweis von Satz 4.2 fixieren wir auf X eine Metrik \tilde{d} , bezüglich der X totalbeschränkt ist und bezeichnen die Vervollständigung von X bezüglich dieser Metrik mit \tilde{X} . \tilde{X} ist als kompakter metrischer Raum polnisch, weshalb $X \subseteq \tilde{X}$ nach Satz 2.10 eine G_δ -Teilmenge ist. Indem wir ein Maß $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$ mittels $\mu(B) := \mu(B \cap X)$, $B \in \mathcal{B}(\tilde{X})$ auf \tilde{X} fortsetzen, können wir $\mathcal{M}_+(X)$ als Teilmenge von $\mathcal{M}_+(\tilde{X})$ auffassen. Da $\mathcal{M}_+(\tilde{X})$ nach Hilfssatz 4.7 polnisch ist, genügt es also nach Satz 2.10 zu zeigen, dass $\mathcal{M}_+(X) \subseteq \mathcal{M}_+(\tilde{X})$ eine G_δ -Teilmenge ist.

Da $X \subseteq \tilde{X}$ eine G_δ -Teilmenge ist, existieren offene Mengen $U_k \subseteq \tilde{X}$, $k \in \mathbb{N}$ so, dass $X = \bigcap_{k \in \mathbb{N}} U_k$ gilt. Insbesondere ist damit auch $\mathcal{M}_+(X) = \bigcap_{k \in \mathbb{N}} \mathcal{M}_+(U_k)$. Für $k, r \in \mathbb{N}$ setzen wir nun

$$V_{k,r} := \left\{ \mu \in \mathcal{M}_+(\tilde{X}) \mid \mu(U_k^c) < \frac{1}{r} \right\}.$$

Mit diesen Mengen folgt dann $\mathcal{M}_+(U_k) = \bigcap_{r \in \mathbb{N}} V_{k,r}$ für alle $k \in \mathbb{N}$ und insbesondere auch

$$\mathcal{M}_+(X) = \bigcap_{k \in \mathbb{N}} \bigcap_{r \in \mathbb{N}} V_{k,r}.$$

Es genügt also zu beweisen, dass $V_{k,r}$ für alle $k, r \in \mathbb{N}$ offen ist, was äquivalent zur Abgeschlossenheit von

$$C_{k,r} := V_{k,r}^c = \left\{ \mu \in \mathcal{M}_+(\tilde{X}) \mid \mu(U_k^c) \geq \frac{1}{r} \right\}$$

für alle $k, r \in \mathbb{N}$ ist. Wir verwenden hierfür die Charakterisierung abgeschlossener Mengen durch Netze aus Satz 2.4 (a). Fixiere $k, r \in \mathbb{N}$. Sei nun $(\mu_\iota)_{\iota \in I}$ ein Netz in $C_{k,r}$, das schwach gegen ein $\mu \in \mathcal{M}_+(\tilde{X})$ konvergiert. Dann ist $\mu_\iota(U_k^c) \geq \frac{1}{r}$ für alle $\iota \in I$ und damit nach dem Portmanteau-Theorem (Satz 3.5 (iv))

$$\mu(U_k^c) \geq \limsup_{\iota \rightarrow \infty} \mu_\iota(U_k^c) \geq \frac{1}{r},$$

was $\mu \in C_{k,r}$ impliziert. Daher ist $C_{k,r}$ für alle $k, r \in \mathbb{N}$ abgeschlossen und der Beweis vollständig.

Die Rückrichtung folgt wieder unmittelbar aus Satz 4.1: Sei $\mathcal{M}_+(X)$ polnisch, so können wir $X \cong \Delta \subseteq \mathcal{M}_+(X)$ betrachten. Weil Δ wegen der Metrisierbarkeit von $\mathcal{M}_+(X)$ nun auch abgeschlossen und damit nach Satz 2.9 eine G_δ -Teilmenge von $\mathcal{M}_+(X)$ ist, liefert Satz 2.10 die Behauptung. \square

Bemerkung. Satz 4.2 und Satz 4.6 gelten auch, wenn man $\mathcal{M}_+(X)$ durch $\mathcal{P}(X)$ ersetzt (für Satz 4.6 folgt die Hinrichtung dann etwa aus der Abgeschlossenheit von $\mathcal{P}(X) \subseteq \mathcal{M}_+(X)$).

Satz 4.8. Sei X ein metrisierbarer topologischer Raum. Dann ist $\mathcal{P}(X)$ genau dann metrisierbar und kompakt, wenn X kompakt ist.

Beweis. Im Wesentlichen stellen wir den Beweis von Proposition 5.3 in [van03] vor.

Für die Hinrichtung sei X zunächst kompakt. Dann ist X insbesondere separabel und damit ist $\mathcal{P}(X)$ nach Satz 4.2 metrisierbar. Außerdem setzen wir

$$A := \left\{ l \in C_b(X)^* \mid \|l\|_{C_b(X)^*} \leq 1, l(\mathbf{1}_X) = 1, \forall f \in C_b(X) \text{ mit } f \geq 0 : l(f) \geq 0 \right\}$$

und analog zu (3.1)

$$\Phi: \mathcal{P}(X) \rightarrow A, \mu \mapsto \left[l_\mu: C_b(X) \rightarrow \mathbb{R}, f \mapsto \int f d\mu \right].$$

Der Darstellungssatz von Riesz-Markov (vgl. [Sim15, Satz 4.8.8]) liefert die Bijektivität von Φ , also ist Φ ein Homöomorphismus zwischen $\mathcal{P}(X)$ und $A \subseteq C_b(X)^*$ mit der Schwach-*-Topologie. Mit dem Satz von Banach-Alaoglu ([Sim15, Satz 5.8.1]) folgt nun, dass A als abgeschlossene Teilmenge des Kompaktums $\left\{ l \in C_b(X)^* \mid \|l\|_{C_b(X)^*} \leq 1 \right\}$ selbst kompakt bezüglich der Schwach-*-Topologie ist, was schließlich die Kompaktheit von $\mathcal{P}(X)$ nach sich zieht.

Die Rückrichtung ist wieder eine direkte Konsequenz aus Satz 4.1: Ist $\mathcal{P}(X)$ metrisierbar und kompakt, so muss $X \cong \Delta$ als abgeschlossene Teilmenge von $\mathcal{P}(X)$ selbst kompakt sein. \square

Bemerkung. *Wir haben in diesem Abschnitt insbesondere gesehen, dass $\mathcal{M}_+(X)$ für metrisierbares und separables X selbst metrisierbar ist. Dies bedeutet auch, dass die schwache Topologie in diesem Fall vollständig durch konvergente Folgen charakterisiert wird. Wir müssen im weiteren Verlauf (bei metrisierbarem und separablem X) also nicht mehr mit dem Konzept des Netzes arbeiten, das wir zu Beginn eingeführt haben. Stattdessen können wir einfach immer Folgen verwenden, um Stetigkeit, Abgeschlossenheit, etc. nachzuweisen.*

5 Straffheit und der Satz von Prokhorov

Das zentrale Resultat dieses Abschnitts stellt der *Satz von Prokhorov* (Satz 5.4) dar, der für einen polnischen Raum X eine einfache Charakterisierung der Kompaktheit von Teilmengen von $\mathcal{P}(X)$ bereitstellt. Hierfür werden wir zunächst das Konzept der *Straffheit* einführen.

Wir orientieren uns im folgenden Abschnitt an [Sim15, Kapitel 4.14].

Definition 5.1. Sei X ein polnischer Raum und $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$. Dann nennen wir eine Teilmenge $A \subseteq \mathcal{M}_+(X)$ straff, falls es für jedes $\varepsilon > 0$ eine kompakte Teilmenge $K_\varepsilon \subseteq X$ gibt mit

$$\mu(K_\varepsilon) \geq \mu(X) - \varepsilon$$

für alle $\mu \in A$.

Ferner heißt ein Maß $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$ straff, falls $\{\mu\}$ straff ist.

Im folgenden Satz werden wir sehen, dass wir es tatsächlich sehr häufig mit straffen Maßen zu tun haben.

Satz 5.2. Sei X ein polnischer Raum und $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$. Dann ist μ straff.

Beweis. Sei d eine Metrik, die X vollständig metrisiert und sei $\mathcal{D} := \{x_m \mid m \in \mathbb{N}\}$ eine abzählbare dichte Teilmenge von X . Für $k \in \mathbb{N}$ gilt also $\bigcup_{m \in \mathbb{N}} B_{1/k}(x_m) = X$ und Maßstetigkeit von unten impliziert $\lim_{M \rightarrow \infty} \mu(\bigcup_{m=1}^M B_{1/k}(x_m)) = \mu(X)$.

Sei nun $\varepsilon > 0$. Dann finden wir natürliche Zahlen $M_1 \leq M_2 \leq \dots$ mit

$$\mu\left(\bigcup_{m=1}^{M_k} B_{1/k}(x_m)\right) \geq \mu(X) - \frac{\varepsilon}{2^k}$$

für alle $k \in \mathbb{N}$. Wir setzen nun

$$S_\varepsilon := \bigcap_{k \in \mathbb{N}} \left(\bigcup_{m=1}^{M_k} B_{1/k}(x_m) \right) \quad \text{und} \quad K_\varepsilon := \overline{S_\varepsilon}.$$

Offenbar ist S_ε totalbeschränkt und damit ist $K_\varepsilon = \overline{S_\varepsilon}$ kompakt (dies wird etwa in [Sim15, Satz 2.3.8] bewiesen, hier geht die Vollständigkeit von (X, d) ein). Außerdem berechnen wir

$$\begin{aligned} \mu(K_\varepsilon) &\geq \mu(S_\varepsilon) \geq \mu(X) - \sum_{k=1}^{\infty} \left(\mu(X) - \mu\left(\bigcup_{m=1}^{M_k} B_{1/k}(x_m)\right) \right) \\ &\geq \mu(X) - \sum_{k=1}^{\infty} \frac{\varepsilon}{2^k} = \mu(X) - \varepsilon. \end{aligned}$$

Weil $\varepsilon > 0$ beliebig gewählt war, ist μ also straff. □

Ohne große Mühen liefert uns der vorige Satz nun, dass endliche Borel-Maße auf polnischen Räumen regulär sind.

Folgerung 5.3. Ist X ein polnischer Raum, so ist jedes $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$ regulär.

Beweis. Sei $\mu \in \mathcal{M}_+(X)$ und $B \in \mathcal{B}(X)$. Wegen Satz 2.20 wissen wir bereits, dass

$$\mu(B) = \sup_{\substack{C \subseteq B \\ C \text{ abgeschlossen}}} \mu(C) \quad \text{bzw.} \quad \mu(B) = \inf_{\substack{U \supseteq B \\ U \text{ offen}}} \mu(U)$$

gilt. Sei nun $\varepsilon > 0$. Dann gibt es eine abgeschlossene Teilmenge $C \subseteq B \subseteq X$ mit $\mu(B \setminus C) < \varepsilon$. Außerdem gibt es nach Satz 5.2 eine kompakte Menge $\tilde{K} \subseteq X$ mit $\mu(\tilde{K}) \geq 1 - \varepsilon$. Setzen wir nun $K := \tilde{K} \cap C$, so ist K ebenfalls kompakt und $K \subseteq B$ mit

$$\mu(B \setminus K) = \mu((B \setminus C) \cup (B \setminus \tilde{K})) \leq \mu(B \setminus C) + \mu(K^{*c}) \leq 2\varepsilon.$$

Daher folgt

$$\mu(B) = \sup_{\substack{K \subseteq B \\ K \text{ kompakt}}} \mu(K)$$

und insgesamt μ ist regulär. \square

Wir möchten nun zum zentralen Satz dieses Abschnitts gehen, der uns eine interessante Charakterisierung der Kompaktheit von Teilmengen von $\mathcal{P}(X)$ liefert, sofern wir X als polnisch voraussetzen.

Satz 5.4 (Prokhorov). *Sei X ein polnischer Raum und $A \subseteq \mathcal{P}(X)$. Dann sind folgende Aussagen äquivalent:*

- (i) A ist straff.
- (ii) $\overline{A} \subseteq \mathcal{P}(X)$ ist kompakt.

Beweis. Sei zunächst $A \subseteq \mathcal{P}(X)$ straff. Wir möchten nun beweisen, dass \overline{A} kompakt ist, was wegen der Metrisierbarkeit von $\mathcal{P}(X)$ (siehe Satz 4.2 bzw. Satz 4.6) äquivalent dazu ist, dass jede Folge $(\mu_n)_n \in A^{\mathbb{N}}$ eine schwach konvergente Teilfolge besitzt.

Aufgrund der Straffheit von A gibt es für jedes $m \in \mathbb{N}$ ein Kompaktum $K^{(m)} \subseteq X$, das für alle $n \in \mathbb{N}$

$$\mu_n(K^{(m)}) \geq 1 - \frac{1}{m+1} \quad (5.1)$$

erfüllt. Ohne Einschränkung dürfen wir außerdem annehmen, dass

$$K^{(m)} \subseteq K^{(m+1)} \quad (5.2)$$

für alle $m \in \mathbb{N}$ gilt.

Sei nun also $(\mu_n)_n \in A^{\mathbb{N}}$. In Analogie zu Satz 4.8 lässt sich einsehen, dass

$$\mathcal{M}_{+, \leq 1}(K^{(m)}) := \left\{ \mu: \mathcal{B}(K^{(m)}) \rightarrow [0, 1] \mid \mu \text{ ist endliches Maß und } \mu(K^{(m)}) \leq 1 \right\}$$

für alle $m \in \mathbb{N}$ kompakt bezüglich der schwachen Topologie ist. Damit existiert ein Maß $\nu^{(1)} \in \mathcal{M}_{+, \leq 1}(K^{(1)})$ und eine Teilfolge $(\mu_{n_j}^{(1)})_j$ von $(\mu_n)_n$ mit

$$\mu_{n_j}^{(1)} \Big|_{K^{(1)}} \xrightarrow{w} \nu^{(1)}.$$

Auf dieselbe Art und Weise lassen für alle $m \geq 2$ sukzessive Maße $\nu^{(m)} \in \mathcal{M}_{+, \leq 1}(K^{(m)})$ und Teilfolgen $(\mu_{n_j}^{(m)})_j$ von $(\mu_{n_j}^{(m-1)})_j$ mit

$$\mu_{n_j}^{(m)} \Big|_{K^{(m)}} \xrightarrow{w} \nu^{(m)}, \quad j \rightarrow \infty$$

finden. Nun diagonalisieren wir und erhalten mit $\mu_{n_j} := \mu_{n_j}^{(j)}$ eine Teilfolge $(\mu_{n_j})_j$ von $(\mu_n)_n$, die

$$\mu_{n_j} \Big|_{K^{(m)}} \xrightarrow{w} \nu^{(m)}, \quad j \rightarrow \infty$$

für alle $m \in \mathbb{N}$ erfüllt.

Außerdem können die Maße $\nu^{(m)}$, $m \in \mathbb{N}$ via $\nu^{(m)}(B) := \nu^{(m)}(B \cap K^{(m)})$, $B \in \mathcal{B}(X)$ einfach auf X fortgesetzt werden. Mit dieser Konvention können wir nun beweisen, dass die Maße $\nu^{(m)}$, $m \in \mathbb{N}$ in dem Sinne monoton wachsen, dass

$$\nu^{(m)}(B) \leq \nu^{(m+1)}(B) \quad (5.3)$$

für alle $B \in \mathcal{B}(X)$ und $m \in \mathbb{N}$ gilt.

Wegen schwacher Regularität (vgl. Satz 2.20) genügt es, die Ungleichung (5.3) für abgeschlossene Mengen zu zeigen. Sei also $m \in \mathbb{N}$ fixiert, $C \subseteq X$ abgeschlossen und seien $f_k: X \rightarrow \mathbb{R}$, $k \in \mathbb{N}$ die gleichmäßig stetigen, beschränkten Funktionen aus Hilfssatz 2.9 (wobei irgendeine Metrik auf X , die X metrisiert, fixiert sei). Unter Ausnutzung von (5.2) folgt nun

$$\int_{K^{(m)}} f_k d\mu_{n_j} \leq \int_{K^{(m+1)}} f_k d\mu_{n_j}$$

für alle $k, j \in \mathbb{N}$. Wegen

$$\int_{K^{(m)}} f_k d\mu_{n_j} \rightarrow \int f_k d\nu^{(m)} \quad \text{und} \quad \int_{K^{(m+1)}} f_k d\mu_{n_j} \rightarrow \int f_k d\nu^{(m+1)}, \quad j \rightarrow \infty$$

ist damit auch

$$\int f_k d\nu^{(m)} \leq \int f_k d\nu^{(m+1)}$$

für alle $k \in \mathbb{N}$, was wiederum aufgrund der Konvergenz $f_k \downarrow \mathbf{1}_C$ und dem Satz von Lebesgue Ungleichung (5.3) impliziert.

Schlussendlich möchten wir nun nachweisen, dass durch

$$\nu: \mathcal{B}(X) \rightarrow [0, 1], \quad B \mapsto \sup_{m \in \mathbb{N}} \nu^{(m)}(B)$$

ein Wahrscheinlichkeitsmaß auf X definiert wird, gegen das $(\mu_{n_j})_j$ schwach konvergiert.

Zunächst verifizieren wir, dass ν ein Wahrscheinlichkeitsmaß ist. $\nu(\emptyset) = 0$ ist klar. Weil $\nu^{(m)}$ in $\mathcal{M}_{+, \leq 1}(K^{(m)})$ liegt und wir (5.1) angenommen haben, gilt

$$\nu^{(m)}(X) = \nu^{(m)}(K^{(m)}) \in [1 - \frac{1}{m+1}, 1]$$

für alle $m \in \mathbb{N}$ und damit $\nu(X) = 1$. Für die σ -Additivität seien $B_k \in \mathcal{B}(X)$, $k \in \mathbb{N}$ paarweise disjunkt. Dann gilt

$$\begin{aligned} \nu\left(\bigcup_{k \in \mathbb{N}} B_k\right) &= \sup_{m \in \mathbb{N}} \nu^{(m)}\left(\bigcup_{k \in \mathbb{N}} B_k\right) = \sup_{m \in \mathbb{N}} \sum_{k=1}^{\infty} \nu^{(m)}(B_k) \\ &\stackrel{(5.3)}{=} \sum_{k=1}^{\infty} \sup_{m \in \mathbb{N}} \nu^{(m)}(B_k) = \sum_{k=1}^{\infty} \nu(B_k), \end{aligned}$$

wobei in der vorletzten Gleichung der Satz von Beppo Levi verwendet wurde. Insgesamt haben wir also $\nu \in \mathcal{P}(X)$ nachgewiesen.

Jetzt bleibt lediglich zu zeigen, dass $(\mu_{n_j})_j$ tatsächlich schwach gegen ν konvergiert. Hierfür möchten wir die Charakterisierung (iv) des Portmanteau-Theorems (Satz 3.5) verwenden. Sei dazu $C \subseteq X$ abgeschlossen. Zunächst liefert ebendieser Satz für alle $m \in \mathbb{N}$ die Abschätzung $\limsup_{j \rightarrow \infty} \mu_{n_j}(C \cap K^{(m)}) \leq \nu^{(m)}(C)$ und wegen (5.1) ist zudem $\mu_{n_j}(C \cap K^{(m)c}) \leq \frac{1}{m+1}$ für alle $j, m \in \mathbb{N}$. Insgesamt folgt daraus

$$\begin{aligned} \limsup_{j \rightarrow \infty} \mu_{n_j}(C) &= \lim_{m \rightarrow \infty} \limsup_{j \rightarrow \infty} \left(\mu_{n_j}(C \cap K^{(m)}) + \mu_{n_j}(C \cap K^{(m)c}) \right) \\ &\leq \lim_{m \rightarrow \infty} \left(\nu^{(m)}(C) + \frac{1}{m+1} \right) = \nu(C), \end{aligned}$$

was den Beweis der Hinrichtung von Satz 5.4 abschließt.

Für die Rückrichtung sei nun \overline{A} kompakt. Außerdem sei d eine Metrik, die X vollständig metrisiert und $\mathcal{D} := \{x_n \mid n \in \mathbb{N}\} \subseteq X$ eine abzählbare dichte Teilmenge.

Wir behaupten, dass für alle $\delta > 0$ ein solches $M_\delta \in \mathbb{N}$ existiert, dass

$$\mu\left(\bigcup_{m=1}^{M_\delta} B_\delta(x_m)\right) > 1 - \delta \quad (5.4)$$

für alle $\mu \in A$ gilt. Denn falls es kein derartiges M_δ gibt, so lässt sich ein $\delta > 0$ finden, für das für alle $M \in \mathbb{N}$ ein $\mu_M \in A$ existiert mit

$$\mu_M\left(\bigcup_{m=1}^M B_\delta(x_m)\right) \leq 1 - \delta.$$

Insbesondere bedeutet das natürlich auch, dass wir für alle $M \in \mathbb{N}$ und $N \geq M$

$$\mu_N\left(\bigcup_{m=1}^M B_\delta(x_m)\right) \leq 1 - \delta$$

abschätzen dürfen. Aufgrund der Kompaktheit von \overline{A} gibt es eine Teilfolge $(\mu_{N_j})_j$ von $(\mu_N)_N$, die einen schwachen Grenzwert $\mu \in \mathcal{P}(X)$ besitzt. Fixiere nun ein $M \in \mathbb{N}$. Dann ist $\bigcup_{m=1}^M B_\delta(x_m)$ offen und daher liefert Charakterisierung (v) des Portmanteau-Theorems (Satz 3.5)

$$\mu\left(\bigcup_{m=1}^M B_\delta(x_m)\right) \leq \liminf_{j \rightarrow \infty} \mu_{N_j}\left(\bigcup_{m=1}^M B_\delta(x_m)\right) \leq 1 - \delta. \quad (5.5)$$

Wegen $\bigcup_{m=1}^\infty B_\delta(x_m) = X$ und Maßstetigkeit von unten folgt aus (5.5) unmittelbar

$$\mu(X) \leq 1 - \delta < 1,$$

was einen Widerspruch dazu darstellt, dass es sich bei μ um ein Wahrscheinlichkeitsmaß auf X handelt. Also muss unsere Behauptung in (5.4) tatsächlich gelten.

Sei nun ein $\varepsilon > 0$ gegeben. Wir setzen

$$S_\varepsilon := \bigcap_{k \in \mathbb{N}} \bigcup_{m=1}^{M_{\varepsilon/2^k}} B_{\varepsilon/2^k}(x_m)$$

und verfahren nun ähnlich wie im Beweis von Satz 5.2: Offensichtlich ist S_ε total beschränkt und damit auch $K_\varepsilon := \overline{S_\varepsilon}$ kompakt (vgl. [Sim15, Satz 2.3.8]). Außerdem gilt für alle $\mu \in A$

$$\mu(K_\varepsilon) \geq \mu(S_\varepsilon) = \mu\left(\bigcap_{k \in \mathbb{N}} \bigcup_{m=1}^{M_{\varepsilon/2^k}} B_{\varepsilon/2^k}(x_m)\right) \geq 1 - \sum_{k=1}^{\infty} \frac{\varepsilon}{2^k} = 1 - \varepsilon$$

und damit ist A straff. □

6 Die Wassersteinmetrik

Wir orientieren uns an [Vil09].

6.1 Kopplungen

Definition 6.1 (Kopplung). Seien X, Y topologische Räume und $A \subseteq \mathcal{P}(X)$, $B \subseteq \mathcal{P}(Y)$. Wir definieren dann

$$\Pi(A, B) := \{ \pi \in \mathcal{P}(X \times Y) \mid \pi(\cdot \times Y) \in A \text{ und } \pi(X \times \cdot) \in B \}.$$

Für $\mu \in \mathcal{P}(X)$ und $\nu \in \mathcal{P}(Y)$ definieren wir außerdem $\Pi(\mu, \nu) := \Pi(\{\mu\}, \{\nu\})$ und nennen die Elemente von $\Pi(\mu, \nu)$ Kopplungen von μ und ν oder auch Transportpläne zwischen μ und ν .

Hilfssatz 6.2. Seien X, Y polnische Räume und $A \subseteq \mathcal{P}(X)$ sowie $B \subseteq \mathcal{P}(Y)$. Dann gelten die folgenden Implikationen:

- (a) Sind A und B straff, so ist auch $\Pi(A, B) \subseteq \mathcal{P}(X \times Y)$ straff.
- (b) Sind A und B abgeschlossen, so ist auch $\Pi(A, B) \subseteq \mathcal{P}(X \times Y)$ abgeschlossen.
- (c) Sind A und B kompakt, so ist auch $\Pi(A, B) \subseteq \mathcal{P}(X \times Y)$ kompakt.

Beweis. Zunächst möchten wir Aussage (a) zeigen. Fixiere dazu ein beliebiges $\varepsilon > 0$ und wähle kompakte Teilmengen $K_{\varepsilon/2} \subseteq X$ sowie $L_{\varepsilon/2} \subseteq Y$ so, dass $\mu(K_{\varepsilon/2}) \geq 1 - \frac{\varepsilon}{2}$ für alle $\mu \in A$ und $\nu(L_{\varepsilon/2}) \geq 1 - \frac{\varepsilon}{2}$ für alle $\nu \in B$ gilt. Dann ist $K_{\varepsilon/2} \times L_{\varepsilon/2} \subseteq \mathcal{P}(X \times Y)$ auch kompakt und für jede Kopplung π von μ und ν gilt

$$\begin{aligned} \pi(K_{\varepsilon/2} \times L_{\varepsilon/2}) &= 1 - \pi(K_{\varepsilon/2}^c \times Y \cup X \times L_{\varepsilon/2}^c) \\ &\geq 1 - \mu(K_{\varepsilon/2}^c) - \nu(L_{\varepsilon/2}^c) \geq 1 - \varepsilon, \end{aligned}$$

also ist auch $\Pi(A, B) \subseteq \mathcal{P}(X \times Y)$ straff.

Da mit X und Y auch $X \times Y$ polnisch ist (siehe Folgerung 2.15), können wir für Aussage (b) mit der Charakterisierung von Abgeschlossenheit durch Folgen arbeiten. Seien also A und B abgeschlossen und sei $(\pi_k)_k \in \Pi(A, B)^{\mathbb{N}}$ eine schwach konvergente Folge mit Grenzwert $\pi \in \mathcal{P}(X \times Y)$. Dann ist für alle abgeschlossenen Teilmengen $C \subseteq X$ auch $C \times Y \subseteq X \times Y$ abgeschlossen und das Portmanteau-Theorem (Satz 3.5) liefert

$$\limsup_{k \rightarrow \infty} \pi_k(C \times Y) \leq \pi(C \times Y).$$

Damit konvergiert $(\pi_k(\cdot \times Y))_k \in A^{\mathbb{N}}$ wiederum nach dem Portmanteau-Theorem schwach gegen $\pi(\cdot \times Y)$ und die Abgeschlossenheit von $A \subseteq \mathcal{P}(X)$ liefert, dass $\pi(\cdot \times Y) \in A$ enthalten ist. Analog folgt $\pi(X \times \cdot) \in B$, also ist insgesamt $\pi \in \Pi(A, B)$. Daher ist $\Pi(A, B)$ abgeschlossen.

Durch eine Anwendung des Satzes von Prokhorov (Satz 5.4) können wir aus (a) und (b) unmittelbar auch Aussage (c) folgern, denn dieser liefert, dass sowohl in $\mathcal{P}(X)$ und $\mathcal{P}(Y)$ als auch in $\mathcal{P}(X \times Y)$ kompakte Teilmengen gerade den Teilmengen entsprechen, die straff und abgeschlossen sind. \square

Hilfssatz 6.3. Seien X, Y metrisierbare topologische Räume und seien $(\mu_k)_k \in \mathcal{P}(X)^{\mathbb{N}}$, $\mu \in \mathcal{P}(X)$, $(\nu_k)_k \in \mathcal{P}(Y)^{\mathbb{N}}$ und $\nu \in \mathcal{P}(Y)$ mit

$$\mu_k \xrightarrow{w} \mu \quad \text{und} \quad \nu_k \xrightarrow{w} \nu, \quad k \rightarrow \infty.$$

Sei außerdem $\pi_k \in \Pi(\mu_k, \nu_k)$ für alle $k \in \mathbb{N}$ und $\pi \in \mathcal{P}(X \times Y)$ so, dass

$$\pi_k \xrightarrow{w} \pi, \quad k \rightarrow \infty.$$

Dann ist $\pi \in \Pi(\mu, \nu)$.

Beweis. Wie im Beweis von Hilfssatz 6.2 gilt hier auch

$$\pi_k(\cdot \times Y) \xrightarrow{w} \pi(\cdot \times Y) \quad \text{und} \quad \pi_k(X \times \cdot) \xrightarrow{w} \pi(X \times \cdot), \quad k \rightarrow \infty.$$

Wegen $\pi_k(\cdot \times Y) = \mu_k$ und $\pi_k(X \times \cdot) = \nu_k$ für alle $k \in \mathbb{N}$ folgt damit aber insbesondere auch $\pi(\cdot \times Y) = \mu$ und $\pi(X \times \cdot) = \nu$, also ist π in $\Pi(\mu, \nu)$ enthalten. \square

6.2 Optimaler Transport

Definition 6.4 (Kosten eines Transportplans). *Seien X, Y topologische Räume, $\mu \in \mathcal{P}(X)$, $\nu \in \mathcal{P}(Y)$ und $c: X \times Y \rightarrow [0, \infty]$ eine $\mathcal{B}(X \times Y)$ -messbare Kostenfunktion. Die Kosten von $\pi \in \Pi(\mu, \nu)$ möchten wir dann mit*

$$C(\pi) := \int c \, d\pi = \int_{X \times Y} c(x, y) \pi(d(x, y)) \in [0, \infty]$$

bezeichnen.

Satz 6.5 (Existenz eines optimalen Transportplans). *Seien X, Y polnische Räume, $\mu \in \mathcal{P}(X)$, $\nu \in \mathcal{P}(Y)$ und $c: X \times Y \rightarrow [0, \infty]$ eine $\mathcal{B}(X \times Y)$ stetige Kostenfunktion. Dann existiert eine Kopplung $\hat{\pi}$ von μ und ν , die*

$$C(\hat{\pi}) = \min_{\pi \in \Pi(\mu, \nu)} C(\pi)$$

erfüllt. Wir nennen $\hat{\pi}$ eine optimale Kopplung von μ und ν oder auch einen optimalen Transportplan zwischen μ und ν .

Hilfssatz 6.6. *In der Situation von Satz 6.5 gilt für jede schwach konvergente Folge $(\pi_k)_k \in \mathcal{P}(X \times Y)^\mathbb{N}$ mit Grenzwert $\pi \in \mathcal{P}(X \times Y)$ die Ungleichung*

$$C(\pi) \leq \liminf_{k \rightarrow \infty} C(\pi_k).$$

Beweis. Setzen wir $c_l := \min(c, l) \in C_b(X)$ für alle $l \in \mathbb{N}$, so gilt $c_l \uparrow c$ punktweise. Sei nun $(\pi_k)_k \in \mathcal{P}(X \times Y)^\mathbb{N}$ mit $\pi_k \xrightarrow{w} \pi \in \mathcal{P}(X \times Y)$ eine schwach konvergente Folge. Dann gilt $\int c_l \, d\pi_k \leq \int c \, d\pi_k$ für alle $k, l \in \mathbb{N}$ und damit auch

$$\int c_l \, d\pi = \lim_{k \rightarrow \infty} \int c_l \, d\pi_k \leq \liminf_{k \rightarrow \infty} \int c \, d\pi_k$$

für alle $l \in \mathbb{N}$. Der Satz von Beppo Levi liefert also

$$\int c \, d\pi = \lim_{l \rightarrow \infty} \int c_l \, d\pi \leq \liminf_{k \rightarrow \infty} \int c \, d\pi_k$$

und es folgt die Behauptung. \square

Beweis von Satz 6.5. Zunächst sind $\{\mu\} \subseteq \mathcal{P}(X)$ und $\{\nu\} \subseteq \mathcal{P}(Y)$ kompakt, also ist $\Pi(\mu, \nu) \subseteq \mathcal{P}(X \times Y)$ wegen Hilfssatz 6.2 (c) ebenfalls kompakt. Sei nun $(\pi_k)_k \in \Pi(\mu, \nu)^\mathbb{N}$ mit

$$C(\pi_k) \rightarrow \inf_{\pi \in \Pi(\mu, \nu)} C(\pi), \quad k \rightarrow \infty.$$

Dann gibt es eine Teilfolge $(\pi_{k_l})_l$ und ein $\hat{\pi} \in \Pi(\mu, \nu)$ mit $\pi_{k_l} \xrightarrow{w} \hat{\pi}$. Nach Hilfssatz 6.6 gilt

$$C(\hat{\pi}) \leq \liminf_{k \rightarrow \infty} C(\pi_k) = \inf_{\pi \in \Pi(\mu, \nu)} C(\pi),$$

was bedeutet, dass $\hat{\pi}$ ein optimaler Transportplan zwischen μ und ν ist. \square

Satz 6.7. Seien X, Y polnische Räume, sei $c: X \times Y \rightarrow [0, \infty)$ eine stetige Kostenfunktion und seien $A \subseteq \mathcal{P}(X)$ und $B \subseteq \mathcal{P}(Y)$ kompakte Teilmengen. Dann ist

$$\hat{\Pi}(A, B) := \{ \pi \in \Pi(A, B) \mid \pi \text{ ist eine optimale Kopplung} \} \subseteq \mathcal{P}(X \times Y)$$

kompakt.

Beweis. Siehe [Vil09, Folgerung 5.21]. □

6.3 Wassersteinmetriken

Definition 6.8. Sei (X, d) ein polnischer metrischer Raum, sei $p \in [1, \infty)$ und seien $\mu, \nu \in \mathcal{P}(X)$. Dann nennen wir

$$W_p(\mu, \nu) := \left(\inf_{\pi \in \Pi(\mu, \nu)} \int_{X \times X} d(x, y)^p \pi(d(x, y)) \right)^{1/p} \in [0, \infty]$$

die p -te Wassersteindistanz zwischen μ und ν .

Bemerkung. Seien $x_0, y_0 \in X$. Wegen $\Pi(\delta_{x_0}, \delta_{y_0}) = \{\delta_{(x_0, y_0)}\} \subseteq \mathcal{P}(X \times X)$ folgt

$$W_p(\delta_{x_0}, \delta_{y_0}) = \left(\int_{X \times X} d(x, y)^p \delta_{(x_0, y_0)}(d(x, y)) \right)^{1/p} = d(x_0, y_0).$$

Die Einbettung

$$(X, d) \rightarrow (\mathcal{P}(X), W_p), \quad x \mapsto \delta_x$$

ist also isometrisch.

Satz 6.9. In der Situation von Definition 6.8 erfüllt W_p die Eigenschaften einer Metrik, abgesehen davon, dass $W_p(\mu, \nu) = \infty$ möglich ist.

Beweis. Offensichtlich ist W_p symmetrisch.

Für die positive Definitheit seien $\mu, \nu \in \mathcal{P}(X)$ mit $W_p(\mu, \nu) = 0$. Dann ist

$$W_p(\mu, \nu)^p = \inf_{\pi \in \Pi(\mu, \nu)} \int_{X \times X} d(x, y)^p \pi(d(x, y)) = 0$$

und da die Zuordnung $(x, y) \mapsto d(x, y)$ stetig ist, existiert nach Satz 6.5 eine Kopplung $\hat{\pi} \in \Pi(\mu, \nu)$ mit

$$\int_{X \times X} d(x, y)^p \hat{\pi}(d(x, y)) = 0.$$

Damit folgt $\hat{\pi}(\{(x, x) \mid x \in X\}) = \hat{\pi}(\{d(x, y)^p = 0\}) = 1$ und für jedes $B \in \mathcal{B}(X)$ gilt $\mu(B) = \hat{\pi}(B \times X) = \hat{\pi}(X \times B) = \nu(B)$, also $\mu = \nu$.

Es bleibt die Dreiecksungleichung zu zeigen. Seien dazu $\mu_1, \mu_2, \mu_3 \in \mathcal{P}(X)$ und seien $\hat{\pi}_{1,2}$ und $\hat{\pi}_{2,3}$ optimale Kopplungen von μ_1 und μ_2 bzw. μ_2 und μ_3 . Nach [Vil09, S. 23-24] gibt es nun ein Wahrscheinlichkeitsmaß $\pi \in \mathcal{P}(X^3)$ mit $\pi(\cdot \times X) = \hat{\pi}_{1,2}$ und $\pi(X \times \cdot) = \hat{\pi}_{2,3}$. Damit gilt

$$\begin{aligned} W_p(\mu_1, \mu_3) &\leq \left(\int_{X \times X} d(x, z)^p \pi(d(x, y, z)) \right)^{1/p} \\ &\leq \left(\int_{X \times X} d(x, y)^p \pi(d(x, y, z)) \right)^{1/p} + \left(\int_{X \times X} d(y, z)^p \pi(d(x, y, z)) \right)^{1/p} \\ &= W_p(\mu_1, \mu_2) + W_p(\mu_2, \mu_3), \end{aligned}$$

wobei wir bei der zweiten Abschätzung die Minkowski-Ungleichung anwenden. □

Bemerkung. Seien $\pi \in \mathcal{P}(X \times X)$, $1 \leq p \leq q < \infty$ und $r \in [1, \infty]$ so, dass $\frac{1}{q/p} + \frac{1}{r} = 1$. Eine Anwendung der Hölder-Ungleichung liefert dann

$$\begin{aligned} \int_{X \times X} d(x, y)^p \pi(d(x, y)) &\leq \left(\int_{X \times X} (d(x, y)^p)^{q/p} \pi(d(x, y)) \right)^{p/q} \left(\int_{X \times X} \pi(d(x, y)) \right)^{1/r} \\ &= \left(\int_{X \times X} d(x, y)^q \pi(d(x, y)) \right)^{p/q}, \end{aligned}$$

was

$$\left(\int_{X \times X} d(x, y)^p \pi(d(x, y)) \right)^{1/p} \leq \left(\int_{X \times X} d(x, y)^q \pi(d(x, y)) \right)^{1/q}$$

und damit

$$W_p(\mu, \nu) \leq W_q(\mu, \nu), \quad \mu, \nu \in \mathcal{P}(X \times X)$$

impliziert.

Satz 6.10 (Dualitätsformel von Kantorovich-Rubinstein). Sei (X, d) ein polnischer metrischer Raum, wobei d eine beschränkte Metrik sei. Wir definieren

$$\text{Lip}_1(X) := \{ f: X \rightarrow \mathbb{R} \mid f \text{ ist 1-lipschitzstetig} \}.$$

Dann gilt für jedes Paar $\mu, \nu \in \mathcal{P}(X)$ von Wahrscheinlichkeitsmaßen

$$W_1(\mu, \nu) = \sup_{f \in \text{Lip}_1(X)} \left(\int f d\mu - \int f d\nu \right).$$

Beweis. Siehe [Vil09, Bemerkung 6.5]. □

Satz 6.11. Sei (X, d) ein polnischer metrischer Raum, wobei d eine beschränkte Metrik sei. Dann gilt für jede Folge $(\mu_k)_k \in \mathcal{P}(X)^\mathbb{N}$ und $\mu \in \mathcal{P}(X)$

$$\mu_k \xrightarrow{w} \mu \iff W_p(\mu_k, \mu) \rightarrow 0, \quad k \rightarrow \infty.$$

Hilfssatz 6.12. In der Situation von Satz 6.11 sei $(\mu_k)_k \in \mathcal{P}(X)^\mathbb{N}$ eine Cauchyfolge bezüglich W_p . Dann ist $\{\mu_k \mid k \in \mathbb{N}\}$ straff.

Beweis. Sei $(\mu_k)_k \in \mathcal{P}(X)^\mathbb{N}$ eine Cauchyfolge bezüglich W_p , also

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \sup_{l \geq k} W_p(\mu_k, \mu_l) = 0.$$

Wegen $W_1 \leq W_p$ ist $(\mu_k)_k$ dann auch insbesondere bezüglich W_1 eine Cauchyfolge.

Fixiere nun ein beliebiges $\varepsilon > 0$. Dann gibt es ein derartiges $n \in \mathbb{N}$, dass

$$W_1(\mu_n, \mu_k) < \varepsilon^2$$

für alle $k \geq n$ gilt. Offenbar können wir damit insbesondere auch für jedes $k \in \mathbb{N}$ ein $j \in \{1, \dots, n\}$ mit $W_1(\mu_j, \mu_k) < \varepsilon^2$ finden. Wegen Satz 5.2 ist $\{\mu_1, \dots, \mu_n\}$ straff, also existiert ein Kompaktum $K \subseteq X$ so, dass

$$\mu_j(K) \geq 1 - \varepsilon, \quad j \in \{1, \dots, n\}$$

gilt. Da K kompakt ist, existieren endlich viele $x_1, \dots, x_m \in X$ mit $K \subseteq U := \bigcup_{i=1}^m B_\varepsilon(x_i)$. Außerdem schreiben wir im Folgenden

$$U_\varepsilon := \bigcup_{i=1}^m B_{2\varepsilon}(x_i) \supseteq \{x \in X \mid d(x, U) < \varepsilon\}$$

und setzen

$$\varphi: X \rightarrow \mathbb{R}, \quad x \mapsto \max \left(1 - \frac{d(x, U)}{\varepsilon}, 0 \right).$$

Offensichtlich ist $\mathbb{1}_U \leq \varphi \leq \mathbb{1}_{U_\varepsilon}$ und φ ist $1/\varepsilon$ -lipschitzstetig.

Für $k \in \mathbb{N}$ sei nun $j \in \{1, \dots, n\}$ mit $W_1(\mu_j, \mu_k) < \varepsilon^2$. Da $\varepsilon\varphi$ 1-lipschitzstetig ist, liefert die Dualitätsformel von Kantorovich-Rubinstein (Satz 6.10)

$$W_1(\mu_j, \mu_k) \geq \varepsilon \left(\int \varphi d\mu_k - \int \varphi d\mu_j \right).$$

Also können wir abschätzen:

$$\begin{aligned} \mu_k(U_\varepsilon) &= \int \mathbb{1}_{U_\varepsilon} d\mu_k \geq \int \varphi d\mu_k = \int \varphi d\mu_j + \left(\int \varphi d\mu_k - \int \varphi d\mu_j \right) \\ &\geq \int \varphi d\mu_j - \frac{W_1(\mu_j, \mu_k)}{\varepsilon} \geq \mu_j(U) - \frac{W_1(\mu_j, \mu_k)}{\varepsilon} \\ &\geq \mu_j(K) - \frac{W_1(\mu_j, \mu_k)}{\varepsilon} \geq 1 - \varepsilon - \frac{W_1(\mu_j, \mu_k)}{\varepsilon} \\ &\geq 1 - \varepsilon - \frac{\varepsilon^2}{\varepsilon} = 1 - 2\varepsilon. \end{aligned}$$

Da wir zu Beginn $\varepsilon > 0$ beliebig gewählt haben, können wir die gesamte Argumentation analog für $\varepsilon/2^{(l+1)}$, $l \in \mathbb{N}$ führen und erhalten damit für jedes $l \in \mathbb{N}$ eine endliche Menge $\{x_1^{(l)}, \dots, x_{m_l}^{(l)}\} \subseteq X$ mit

$$\mu_k \left(\bigcup_{i=1}^{m_l} B_{\varepsilon/2^l}(x_i^{(l)}) \right) \geq 1 - \frac{\varepsilon}{2^l}, \quad k \in \mathbb{N}.$$

Nun können wir analog zu den Beweisen von Satz 5.2 und Satz 5.4 vorgehen: Wir setzen

$$S_\varepsilon := \bigcap_{l \in \mathbb{N}} \bigcup_{i=1}^{m_l} B_{\varepsilon/2^l}(x_i^{(l)}) \quad \text{und} \quad K_\varepsilon := \overline{S_\varepsilon}.$$

Da S_ε totalbeschränkt ist, ist K_ε kompakt und für alle $k \in \mathbb{N}$ gilt

$$\mu_k(K_\varepsilon) \geq \mu_k(K_\varepsilon) \geq 1 - \varepsilon,$$

also ist $\{\mu_k \mid k \in \mathbb{N}\}$ straff. □

Hilfssatz 6.13. Sei X ein polnischer Raum und $(\mu_k)_k \in \mathcal{P}(X)^\mathbb{N}$ eine derartige Folge

Beweis von Satz 6.11. Für beide Richtungen des Beweises verwenden die elementare Tatsache, dass für $(\mu_k)_k \in \mathcal{P}(X)^\mathbb{N}$ und $\mu \in \mathcal{P}(X)$ die Äquivalenz

$$\mu_k \xrightarrow{w} \mu \quad \Longleftrightarrow \quad \begin{array}{l} \text{jede Teilfolge } (\mu_{k'})_{k'} \text{ von } (\mu_k)_k \text{ hat} \\ \text{eine Teilfolge } (\mu_{k''})_{k''} \text{ mit } \mu_{k''} \xrightarrow{w} \mu \end{array} \quad (6.1)$$

gilt.

Wir möchten zunächst die Hinrichtung zeigen. Sei dazu $(\mu_k)_k \in \mathcal{P}(X)^\mathbb{N}$ und $\mu \in \mathcal{P}(X)$ mit $\mu_k \xrightarrow{w} \mu$. Sei außerdem $\pi_k \in \Pi(\mu_k, \mu)$ für jedes $k \in \mathbb{N}$ eine optimale Kopplung von μ_k und μ . Insbesondere sind dann $A := \{\mu_k \mid k \in \mathbb{N}\} \cup \{\mu\}$ und $B := \{\mu\}$ kompakt und Satz 6.7 liefert, dass

$$\hat{\Pi}(A, B) := \{\pi \in \Pi(A, B) \mid \pi \text{ ist eine optimale Kopplung}\} \subseteq \mathcal{P}(X \times X)$$

kompakt ist. Sei $(\pi_{k'})_{k'}$ nun eine Teilfolge von $(\pi_k)_k$. Da π_k für jedes $k \in \mathbb{N}$ in $\hat{\Pi}(A, B)$ liegt, hat $(\pi_{k'})_{k'}$ eine Teilfolge $(\pi_{k''})_{k''}$, die schwach gegen ein $\pi' \in \hat{\Pi}(A, B)$ konvergiert. Wegen Hilfssatz 6.3 muss π' eine optimale Kopplung von μ und μ sein, also

$$\int_{X \times X} d(x, y)^p \pi'(d(x, y)) = W_p(\mu, \mu)^p = 0.$$

Daher gilt $\pi'(\{(x, x) \mid x \in X\}) = 1$ und für alle $A, B \in \mathcal{B}(X)$ folgt $\pi'(A \times B) = \mu(A \cap B)$, weshalb π' einfach die triviale Kopplung π von μ und μ ist. Weil $\{\pi_k \mid k \in \mathbb{N}\} \subseteq \hat{\Pi}(A, B)$ gilt, ist $\{\pi_k \mid k \in \mathbb{N}\}$ kompakt und $\{\pi_k \mid k \in \mathbb{N}\}$ damit nach dem Satz von Prokhorov (Satz 5.4) straff. Insgesamt impliziert (6.1) nun also die schwache Konvergenz

$$\pi_k \xrightarrow{w} \pi, \quad k \rightarrow \infty.$$

Da die Zuordnung $(x, y) \mapsto d(x, y)^p$ wegen der Beschränktheit von d aber in $C_b(X \times X)$ enthalten ist, folgt

$$W_p(\mu_k, \mu)^p = \int_{X \times X} d(x, y)^p \pi_k(d(x, y)) \rightarrow \int_{X \times X} d(x, y)^p \pi(d(x, y)) = 0, \quad k \rightarrow \infty,$$

also auch $W_p(\mu_k, \mu) \rightarrow 0$.

Für die Rückrichtung sei nun $(\mu_k)_k \in \mathcal{P}(X)^\mathbb{N}$ und $\mu \in \mathcal{P}(X)$ so, dass $W_p(\mu_k, \mu) \rightarrow 0$. Nach Hilfssatz 6.12 ist $\{\mu_k \mid k \in \mathbb{N}\}$ dann straff, nach dem Satz von Prokhorov ist $\overline{\{\mu_k \mid k \in \mathbb{N}\}}$ also kompakt. Sei $(\mu_{k'})_{k'}$ nun eine Teilfolge von $(\mu_k)_k$. Dann existiert eine derartige Teilfolge $(\mu_{k''})_{k''}$ von $(\mu_{k'})_{k'}$ und ein Wahrscheinlichkeitsmaß $\mu'' \in \mathcal{P}(X)$, dass

$$\mu_{k''} \xrightarrow{w} \mu'', \quad k'' \rightarrow \infty. \quad (6.2)$$

Für $k'' \in \mathbb{N}$ sei $\pi_{k''}$ eine optimale Kopplung von $\mu_{k''}$ und μ . Da $\{\pi_{k''} \mid k'' \in \mathbb{N}\}$ nach Hilfssatz 6.2 straff ist, liefert der Satz von Prokhorov die Existenz einer Teilfolge $(\pi_{k'''})_{k'''}$ von $(\pi_{k''})_{k''}$, die schwach gegen ein $\pi''' \in \mathcal{P}(X \times X)$ konvergiert. Nach Hilfssatz 6.3 ist π''' eine Kopplung von μ'' und μ . Durch eine Anwendung von Hilfssatz 6.6 können wir wie folgt abschätzen:

$$\begin{aligned} W_p(\mu'', \mu)^p &= \inf_{\pi \in \Pi(\mu'', \mu)} \int_{X \times X} d(x, y)^p \pi(d(x, y)) \\ &\leq \int_{X \times X} d(x, y)^p \pi'''(d(x, y)) \\ &\leq \liminf_{k''' \rightarrow \infty} \int_{X \times X} d(x, y)^p \pi_{k'''}(d(x, y)) = \liminf_{k''' \rightarrow \infty} W_p(\mu_{k'''}, \mu)^p = 0. \end{aligned}$$

Da dies $\mu'' = \mu$ impliziert, gilt wegen (6.1) und (6.2) also $\mu_k \xrightarrow{w} \mu$, $k \rightarrow \infty$. \square

Literatur

- [AB06] Charalambos D. Aliprantis und Kim C. Border. *Infinite Dimensional Analysis: A Hitchhiker's Guide*. Third Edition. Berlin, Heidelberg: Springer-Verlag Berlin Heidelberg, 2006. ISBN: 978-3-540-29587-7.
- [Hen16] Norbert Henze. *Wahrscheinlichkeitstheorie*. 2016. URL: <https://www.math.kit.edu/stoch/~henze/media/wt-ss2016-handout-final.pdf>.
- [Jor14] Jordan Bell. *Polish spaces and Baire spaces*. 2014. URL: <http://individual.utoronto.ca/jordanbell/notes/polish.pdf>.
- [Meg98] Robert E. Megginson. *An Introduction to Banach Space Theory*. Bd. 183. Graduate Texts in Mathematics. New York, NY: Springer, 1998. ISBN: 0-387-98431-3.
- [Sim15] Barry Simon. *Real Analysis*. Bd. Part 1. A Comprehensive Course in Analysis. Providence, Rhode Island: AMS American Mathematical Society, 2015. ISBN: 978-1-4704-1099-5.
- [van03] Onno van Gaans. *Probability measures on metric spaces*. 2002/03. URL: <https://www.math.leidenuniv.nl/~vangaans/jancol1.pdf>.
- [Vee58] Veeravalli S. Varadarajan. „Weak Convergence of Measures on Separable Metric Spaces“. In: *Sankhyā: The Indian Journal of Statistics* Vol. 19, No. 1/2 (1958), S. 15–22. URL: <https://www.jstor.org/stable/25048364>.
- [Vil09] Cédric Villani. *Optimal Transport: Old and New*. Bd. 338. Grundlehren der mathematischen Wissenschaften. Berlin: Springer, 2009. ISBN: 978-3-540-71049-3.

Erklärung

Ich versichere wahrheitsgemäß, die Arbeit selbstständig verfasst, alle benutzten Hilfsmittel vollständig und genau angegeben und alles kenntlich gemacht zu haben, was aus Arbeiten anderer unverändert oder mit Abänderungen entnommen wurde, sowie die Satzung des KIT zur Sicherung guter wissenschaftlicher Praxis in der jeweils gültigen Fassung beachtet zu haben.

Ort, den Datum