

Skript zur Vorlesung  
Analysis III  
bei Prof. Dr. Dirk Hundertmark

Karlsruher Institut für Technologie

Wintersemester 2024/25

Dieses Skript ist inoffiziell. Es besteht kein  
Anspruch auf Vollständigkeit oder Korrektheit.

# Inhaltsverzeichnis

<b>1</b>	<b>Einleitung: Motivation für Maßtheorie</b>	<b>3</b>
<b>2</b>	<b><math>\sigma</math>-Algebren und Maße</b>	<b>4</b>
2.1	$\sigma$ -Algebren . . . . .	4
2.2	Maße und Prämaße . . . . .	6
<b>3</b>	<b>[*] Dynkinsysteme</b>	<b>10</b>
<b>4</b>	<b>[*] Eindeutigkeit von Maßen und erste Eigenschaften des Lebesgue-Maßes</b>	<b>12</b>

Alle mit [\*] markierten Kapitel sind noch nicht Korrektur gelesen und bedürfen eventuell noch Änderungen.

# 1 Einleitung: Motivation für Maßtheorie

[21. Okt] Wir wollen in diesem Modul eine Theorie erarbeiten, um Teilmengen des  $\mathbb{R}^n$  messen (das heißt ihnen einen Inhalt zuordnen) zu können. Außerdem soll diese Zuordnung eines Inhalts bestimmten (intuitiv klaren) Anforderungen genügen. Wenn wir zum Beispiel zwei Teilmengen des  $\mathbb{R}^2$   $A$  und  $B$ , die disjunkt sind und denen wir entsprechende Inhalte zugeordnet haben, betrachten, dann soll nach unserem intuitiven geometrischen Verständnis auch gelten

$$\text{Fläche}(A \cup B) = \text{Fläche}(A) + \text{Fläche}(B)$$

Für einfache Teilmengen des  $\mathbb{R}^2$  haben wir bereits eine Möglichkeit, deren Flächeninhalt zu messen:

**Beispiel 1.1.1** (Messen eines Rechtecks). Im Fall eines Rechtecks  $R \subseteq \mathbb{R}^2$  mit den Seitenlängen  $a$  und  $b$  wissen wir bereits, dass wir einen sinnvollen Flächeninhalt durch

$$\text{Fläche}(R) = a \cdot b$$

berechnen können.

**Beispiel 1.1.2** (Messen eines Dreiecks). Auch für ein Dreieck  $D \subseteq \mathbb{R}^2$  mit Grundfläche  $g$  und Höhe  $h$  kennen wir die Formel

$$\text{Fläche}(D) = \frac{1}{2}gh$$

**Beispiel 1.1.3** (Parkettierung). Wir können auch eine komplexere Form  $F \subseteq \mathbb{R}^2$  mittels (abzählbar) unendlich vielen Dreiecken approximieren. Dafür nehmen wir abzählbar viele paarweise disjunkte Dreiecke  $(\Delta_n)_n$ , sodass  $\bigcup_{j \in \mathbb{N}} \Delta_j = F$ . Dann gilt

$$\text{Fläche}(F) = \text{Fläche}\left(\bigcup_{j \in \mathbb{N}} \Delta_j\right) \stackrel{!}{=} \sum_{j=1}^{\infty} \text{Fläche}(\Delta_j)$$

**Bemerkung 1.1.4.** Wir wollen dementsprechend ein Maß finden, also nach unserem Verständnis eine Abbildung  $\mu : \mathcal{F} \rightarrow [0, \infty]$ , wobei  $\mathcal{F} \subseteq \mathcal{P}(E) := \{U : U \subseteq E\}$  eine Familie von Teilmengen von  $E \neq \emptyset$  ist. Außerdem soll gelten, dass

- (i)  $\mu(\emptyset) = 0$
- (ii) Für  $A, B \in \mathcal{F}$  mit  $A \cap B = \emptyset$  ist  $\mu(A \cup B) = \mu(A) + \mu(B)$
- (iii) Für eine Folge  $A_n \in \mathcal{F}$  mit  $A_n \cap A_m = \emptyset$  für  $n \neq m$  ist

$$\mu\left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n\right) = \sum_{j=1}^{\infty} \mu(A_n)$$

Diese Liste an Eigenschaften führt wie wir später sehen werden zu einer reichhaltigen Theorie

---

<sup>1</sup> $\sigma$ -Additivität

## 2 $\sigma$ -Algebren und Maße

### 2.1 $\sigma$ -Algebren

**Definition 2.1.1** ( $\sigma$ -Algebra). Sei  $E \neq \emptyset$  eine Menge. Eine  $\sigma$ -Algebra in  $E$  ist ein System von Teilmengen  $\mathcal{A} \subseteq \mathcal{P}(E)$  von  $E$  mit folgenden Eigenschaften

$$(\Sigma_1) \quad E \in \mathcal{A}$$

$$(\Sigma_2) \quad A \in \mathcal{A} \Rightarrow A^C := E \setminus A \in \mathcal{A}$$

$$(\Sigma_3) \quad \text{Für } (A_n)_n \subseteq \mathcal{A} \text{ gilt } \bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n \in \mathcal{A}. \text{ Das heißt } \mathcal{A} \text{ ist stabil unter (abzählbaren) Vereinigungen}$$

Eine Menge  $A \in \mathcal{A}$  heißt messbar ( $\mathcal{A}$ -messbar).

**Lemma 2.1.2** (Eigenschaften von  $\sigma$ -Algebren). Sei  $\mathcal{A}$  eine  $\sigma$ -Algebra in  $E$ . Dann gilt

$$(i) \quad \emptyset \in \mathcal{A}$$

$$(ii) \quad A, B \in \mathcal{A} \Rightarrow (A \cup B) \in \mathcal{A} \text{ (das heißt } \mathcal{A} \text{ ist auch stabil unter endlichen Vereinigungen)}$$

$$(iii) \quad \text{Für } (A_n)_n \subseteq \mathcal{A} \text{ gilt } \bigcap_{n \in \mathbb{N}} A_n \in \mathcal{A}$$

$$(iv) \quad A, B \in \mathcal{A} \Rightarrow A \setminus B = A \cap B^C \in \mathcal{A}$$

*Beweis.*

$$(i) \quad E \in \mathcal{A} \xrightarrow{(\Sigma_2)} \emptyset = E^C \in \mathcal{A}$$

$$(ii) \quad \text{Wir definieren } A_1 := A, A_2 := B \text{ und } A_i := \emptyset \text{ für } i \geq 3. \text{ Dann gilt } (\Sigma_3)$$

$$A \cup B = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n \in \mathcal{A}$$

$$(iii) \quad A_n \in \mathcal{A} \Rightarrow (A_n)^C \in \mathcal{A} \Rightarrow \bigcup_{n \in \mathbb{N}} (A_n)^C \in \mathcal{A} \Rightarrow \left( \left( \bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n \right)^C \right)^C \in \mathcal{A} \Rightarrow \bigcap_{n \in \mathbb{N}} A_n \in \mathcal{A}$$

$$(iv) \quad A \setminus B = A \cap B^C = A \cap B^C \cap E \cap E \cap \dots. \text{ Dann gilt nach (iii), dass } A \setminus B \in \mathcal{A} \quad \square$$

**Beispiel 2.1.3.** Wir betrachten einige Beispiele für  $\sigma$ -Algebren

$$(a) \quad \text{Für eine Mengen } E \text{ ist die Potenzmenge } \mathcal{P}(E) \text{ selber nach Definition immer eine } \sigma\text{-Algebra über } E.$$

$$(b) \quad \{\emptyset, E\} \text{ ist die kleinste } \sigma\text{-Algebra in } E.$$

$$(c) \quad \text{Für } A \subseteq E \text{ gilt } \mathcal{A} := \{\emptyset, A, A^C, E\} \text{ ist die kleinste } \sigma\text{-Algebra, die } A \text{ enthält.}$$

$$(d) \quad \text{Sei } E \text{ überabzählbar. Dann ist } \mathcal{A} := \{A \subseteq E : A \text{ oder } A^C \text{ ist abzählbar}\} \text{ eine } \sigma\text{-Algebra.}$$

$$(e) \quad \text{Sei } \mathcal{A} \text{ eine } \sigma\text{-Algebra in } E. \text{ Für } F \subseteq E \text{ beliebig ist } \mathcal{A}_F := \{A \cap F : A \in \mathcal{A}\} \text{ die Spur-}\sigma\text{-Algebra von } F.$$

- (f) Seien  $E, E'$  nicht-leere Mengen,  $f : E \rightarrow E'$  eine Funktion und  $\mathcal{A}'$  eine  $\sigma$ -Algebra in  $E'$ . Dann ist auch

$$\mathcal{A} := \{f^{-1}(A') : A' \in \mathcal{A}'\}$$

eine  $\sigma$ -Algebra.

*Beweis von (d).* Wir prüfen die Kriterien

$$(\Sigma_1) \quad E^C = \emptyset \text{ ist abzählbar} \Rightarrow E \in \mathcal{A}$$

$$(\Sigma_2) \quad A \in \mathcal{A} \Leftrightarrow A \text{ oder } A^C \text{ ist abzählbar} \Leftrightarrow A^C \text{ oder } (A^C)^C \text{ ist abzählbar} \Leftrightarrow A^C \in \mathcal{A}$$

$$(\Sigma_3) \quad \text{Sei } A_n \in \mathcal{A} \text{ für } n \in \mathbb{N}. \text{ Wir unterscheiden 2 Fälle}$$

FALL 1: Alle  $A_n$  sind abzählbar. Dann ist auch  $\bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n$  abzählbar.

FALL 2: Ein  $A_j$  ist überabzählbar. Dann ist aber  $(A_j)^C$  abzählbar  $\Rightarrow \bigcap_{n \in \mathbb{N}} (A_n)^C \subseteq (A_j)^C$  ist abzählbar. Dann ist  $(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n)^C = \bigcap_{n \in \mathbb{N}} (A_n)^C$  abzählbar. Das heißt  $\bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n \in \mathcal{A}$ .  $\square$

**Notation 2.1.4** (Durchschnitt). Seien  $I$  eine beliebige Menge und  $(\mathcal{A}_j)_{j \in I} \subseteq \mathcal{P}(E)$  eine beliebige Familie von Mengensystemen in  $E$ . Dann ist

$$\bigcap_{j \in I} \mathcal{A}_j := \{A : A \subseteq \mathcal{A}_j \ \forall j \in I\}$$

der Durchschnitt der  $\mathcal{A}_j$ .

**Satz 2.1.5.** Sei  $I$  eine beliebige Menge und  $(\mathcal{A}_j)_{j \in I}$  eine Familie von  $\sigma$ -Algebren in  $E$ . Dann gilt

$$\bigcap_{j \in I} \mathcal{A}_j$$

ist wieder eine  $\sigma$ -Algebra.

*Beweis.*

$$(\Sigma_1) \quad E \in \mathcal{A}_j \ \forall j \in I \Rightarrow E \subseteq \bigcap_{j \in I} \mathcal{A}_j$$

$$(\Sigma_2) \quad A \in \bigcap_{j \in I} \mathcal{A}_j \Leftrightarrow A \in \mathcal{A}_j \ \forall j \in I. \text{ Daraus folgt } A^C \in \mathcal{A}_j \ \forall j \in I \Rightarrow A^C \in \bigcap_{j \in I} \mathcal{A}_j$$

$$(\Sigma_3) \quad \text{Sei } A_n \in \bigcap_{j \in I} \mathcal{A}_j. \text{ Dann gilt } A_n \in \mathcal{A}_j \ \forall j \in I \Rightarrow \bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n \in \mathcal{A}_j \ \forall j \in I \quad \square$$

**Satz 2.1.6.** Sei  $\zeta \subseteq \mathcal{P}(E)$  für  $E$  nicht-leer ein System von Teilmengen von  $E$ . Dann existiert eine kleinste  $\sigma$ -Algebra  $\sigma(E)$  in  $E$ , welche  $\zeta$  enthält. Das heißt

(a)  $\sigma(\zeta)$  ist eine  $\sigma$ -Algebra in  $E$  und

(b) Für eine  $\sigma$ -Algebra  $\mathcal{A}$  in  $E$  mit  $\zeta \subseteq \mathcal{A}$  folgt  $\sigma(\zeta) \subseteq \mathcal{A}$

Wir nennen  $\sigma(\zeta)$  in diesem Fall die von  $\zeta$  erzeugte  $\sigma$ -Algebra und  $\zeta$  den Erzeuger von  $\sigma(\zeta)$ .

*Beweis.* Wir definieren  $I := \{\mathcal{A} : \mathcal{A} \text{ ist } \sigma\text{-Algebra und } \zeta \subseteq \mathcal{A}\}$  die Menge aller  $\sigma$ -Algebren, die  $\zeta$  enthalten. Dabei gilt  $I$  nicht-leer, da  $\mathcal{P}(E) \in I$ . Damit gilt nach Satz 2.1.5, dass

$$\sigma(\zeta) := \bigcap_{\mathcal{A} \in I} \mathcal{A}$$

eine  $\sigma$ -Algebra ist. Dabei ist  $\zeta \subseteq \sigma(\zeta)$  nach Forderung an  $I$ . Und nach unserer Konstruktion ist auch Anforderung (b) erfüllt.  $\square$

**Beispiel 2.1.7.** Sei  $\zeta := \{A\}$ . Dann ist  $\{\emptyset, A, A^C, E\}$  die von  $\zeta$  erzeugte  $\sigma$ -Algebra.

**Definition 2.1.8.** Sei  $\mathcal{O}_d$  das System der offenen Mengen im  $\mathbb{R}^d$ . Dann definieren wir die *Borel- $\sigma$ -Algebra*

$$\mathcal{B}_d = \mathcal{B}(\mathbb{R}^d) := \sigma(\mathcal{O}_d)$$

## 2.2 Maße und Prämaße

Sei in diesem Teilkapitel stets  $X$  eine Menge.

[25. Okt] **Notation 2.2.1** (Disjunkte Vereinigung). Seien  $A, B$  Mengen mit  $A \cap B = \emptyset$ . Dann schreiben wir  $A \sqcup B := A \cup B$  als disjunkte Vereinigung von  $A$  und  $B$ .

**Definition 2.2.2** (Maß). Ein (positives) Maß  $\mu$  auf  $X$  ist eine Funktion  $\mu : \mathcal{A} \rightarrow [0, \infty]$  mit

(M<sub>0</sub>)  $\mathcal{A}$  ist eine  $\sigma$ -Algebra.

(M<sub>1</sub>)  $\mu(\emptyset) = 0$

(M<sub>2</sub>) Sei  $(A_n)_{n \in \mathbb{N}} \subseteq \mathcal{A}$  eine Folge paarweise disjunkter Mengen. Dann folgt

$$\mu\left(\bigsqcup_{n \in \mathbb{N}} A_n\right) = \sum_{n \in \mathbb{N}} \mu(A_n)$$

**Definition 2.2.3** (Prämaß). Ist  $\mathcal{A} \subseteq \mathcal{P}(X)$  nicht unbedingt eine  $\sigma$ -Algebra und  $\mu : \mathcal{A} \rightarrow [0, \infty]$  eine Funktion, so heißt  $\mu$  Prämaß, falls

(PM<sub>1</sub>)  $\mu(\emptyset) = 0$  (das setzt also auch voraus, dass  $\emptyset \in \mathcal{A}$ )

(PM<sub>2</sub>) Sind  $(A_n)_n \subseteq \mathcal{A}$  paarweise disjunkt und  $(\bigsqcup_{n \in \mathbb{N}} A_n) \in \mathcal{A}$ , dann folgt

$$\mu\left(\bigsqcup_{n \in \mathbb{N}} A_n\right) = \sum_{n \in \mathbb{N}} \mu(A_n)$$

**Definition 2.2.4** (Wachsende und fallende Teilmengenfolgen). Sei  $(A_n)_n$  eine Folge von Teilmengen von  $X$ . Dann nennen wir  $(A_n)_n$

- wachsend, falls  $A_n \subseteq A_{n+1} \ \forall n \in \mathbb{N}$
- fallend, falls  $A_{n+1} \subseteq A_n \ \forall n \in \mathbb{N}$

**Notation 2.2.5.**

1. Für eine wachsende Teilmengenfolge  $(A_n)_n$  schreiben wir  $A_n \nearrow A$ , falls  $\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n = A$ .
2. Für eine fallende Teilmengenfolge  $(A_n)_n$  schreiben wir  $A_n \searrow A$ , falls  $\bigcap_{n=1}^{\infty} A_n = A$ .

**Definition 2.2.6** (Messraum und Maßraum). Sei  $X$  eine Menge,  $\mathcal{A}$  eine  $\sigma$ -Algebra und  $\mu : \mathcal{A} \rightarrow [0, \infty]$  ein Maß.

1. Wir nennen das Paar  $(X, \mathcal{A})$  einen Messraum.
2. Wir nennen das Tripel  $(X, \mathcal{A}, \mu)$  einen Maßraum.

## 2 $\sigma$ -Algebren und Maße

3. Wir nennen  $\mu$  endlich und  $(X, \mathcal{A}, \mu)$  einen endlichen Maßraum, falls  $\mu(X) < \infty$ .
4. Wir nennen  $\mu$  Wahrscheinlichkeitsmaß (W-Maß) und  $(X, \mathcal{A}, \mu)$  einen Wahrscheinlichkeitsraum (W-Raum), falls  $\mu(X) = 1$ .
5. Wir nennen  $\mu$   $\sigma$ -endlich, falls es eine Folge  $(A_n)_n \subseteq \mathcal{A}$  gibt mit  $A_n \nearrow X$  und  $\mu(A_n) < \infty \forall n \in \mathbb{N}$ . In diesem Fall heißt  $(A_n)_n$  eine ausschöpfende Folge.

**Satz 2.2.7** (Eigenschaften von Maßen). Seien  $(X, \mathcal{A}, \mu)$  ein Maßraum sowie  $A, B, A_n, B_n \in \mathcal{A}$ . Dann gilt

- (i)  $A \cap B = \emptyset \Rightarrow \mu(A \sqcup B) = \mu(A) + \mu(B)$  (Additivität)
- (ii)  $A \subseteq B \Rightarrow \mu(A) \leq \mu(B)$  (Monotonie)
- (iii)  $A \subseteq B$  und  $\mu(A) < \infty \Rightarrow \mu(B \setminus A) = \mu(B) - \mu(A)$
- (iv)  $\mu(A \cup B) + \mu(A \cap B) = \mu(A) + \mu(B)$  (Starke Additivität)
- (v)  $\mu(A \cup B) \leq \mu(A) + \mu(B)$  (Subadditivität)
- (vi)  $(A_n)_n \nearrow A \Rightarrow \mu(A) = \sup_{n \in \mathbb{N}} \mu(A_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} \mu(A_n)$  (Stetigkeit von unten)
- (vii)  $(B_n)_n \searrow B$  und  $\mu(B_1) < \infty \Rightarrow \mu(B) = \inf_{n \in \mathbb{N}} \mu(B_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} \mu(B_n)$  (Stetigkeit von oben)
- (viii)  $\mu\left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n\right) \leq \sum_{n \in \mathbb{N}} \mu(A_n)$  ( $\sigma$ -Subadditivität)

*Beweis.*

- (i) Sei  $A_1 := A, A_2 := B$  und  $A_n := \emptyset$  für  $n \geq 3$ . Dann gilt

$$\begin{aligned} A \sqcup B &= \bigsqcup_{n \in \mathbb{N}} A_n \\ \Rightarrow \mu(A \sqcup B) &= \sum_{n=1}^{\infty} \mu(A_n) = \mu(A_1) + \mu(A_2) = \mu(A) + \mu(B) \end{aligned}$$

- (ii) Sei  $A \subseteq B$ , dann folgt  $B = A \sqcup (B \setminus A)$ . Mit (i) folgt

$$\mu(B) = \mu(A \sqcup (B \setminus A)) = \mu(A) + \mu(B \setminus A) \geq \mu(A)$$

- (iii)  $\mu(B) = \mu(A) + \mu(B \setminus A)$ . Dann folgt  $\mu(B \setminus A) = \mu(B) - \mu(A)$ , falls  $\mu(A) < \infty$ .

- (iv) Es gilt  $A \cup B = A \sqcup (B \setminus (A \cap B))$ . Dann folgt

$$\begin{aligned} \mu(A \cup B) + \mu(A \cap B) &= \mu(A \sqcup (B \setminus (A \cap B))) + \mu(A \cap B) \\ &= \mu(A) + \mu(B \setminus (A \cap B)) + \mu(A \cap B) \\ &= \mu(A) + \mu(B) - \mu(A \cap B) + \mu(A \cap B) \\ &= \mu(A) + \mu(B) \end{aligned}$$

- (v) Aus (iv) folgt  $\mu(A) + \mu(B) = \mu(A \cup B) + \mu(A \cap B) \geq \mu(A \cup B)$

- (vi) Sei  $(A_n)_n$  wachsend. Wir definieren eine neue Folge von Mengen  $(F_n)_n$  mit  $F_1 := A_1$  und  $F_n := A_n \setminus A_{n-1}$  für  $n \geq 2$ . Dann sind  $F_j$  paarweise disjunkt und es gilt

$$\begin{aligned} \bigcup_{j=1}^n A_j &= \bigsqcup_{j=1}^n F_j \\ \Rightarrow \mu\left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n\right) &= \mu\left(\bigsqcup_{j \in \mathbb{N}} F_j\right) = \sum_{j=1}^{\infty} \mu(F_j) \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{j=1}^n \mu(F_j) = \lim_{n \rightarrow \infty} \mu\left(\bigsqcup_{j=1}^n F_j\right) \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} \mu(A_n) = \sup_{n \in \mathbb{N}} \mu(A_n) \end{aligned}$$

- (vii) Sei  $(B_n)_n \searrow B$  mit  $\mu(B_1) < \infty$ . Wir definieren  $A_n := B_1 \setminus B_n \nearrow B_1 \setminus B$  wachsend. Dann gilt nach (vi)

$$\begin{aligned} \mu(B_1 \setminus B) &= \lim_{n \rightarrow \infty} \mu(B_1 \setminus B_n) \\ \Rightarrow \mu(B_1) - \mu(B) &= \lim_{n \rightarrow \infty} (\mu(B_1) - \mu(B_n)) = \mu(B_1) - \lim_{n \rightarrow \infty} \mu(B_n) \\ \Rightarrow \mu(B) &= \lim_{n \rightarrow \infty} \mu(B_n) = \inf_{n \in \mathbb{N}} \mu(B_n) \end{aligned}$$

- (viii) Sei  $(A_n)_n \subseteq \mathcal{A}$ . Dann ist  $A := \bigsqcup_{n \in \mathbb{N}} A_n$ . Wir definieren  $\hat{A}_k := \bigcup_{j=1}^k A_j$  wachsend. Dann gilt

$$\bigcup_{k=1}^{\infty} \hat{A}_k = \bigcup_{k=1}^{\infty} \bigcup_{n=1}^k A_n = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n$$

Nach (v) gilt

$$\begin{aligned} \mu(A) &= \mu\left(\bigcup_{k=1}^{\infty} \hat{A}_k\right) = \lim_{k \rightarrow \infty} \mu(\hat{A}_k) = \lim_{k \rightarrow \infty} \mu\left(\bigcup_{j=1}^k A_j\right) \\ &\leq \lim_{k \rightarrow \infty} \sum_{j=1}^k \mu(A_j) = \sum_{n=1}^{\infty} \mu(A_n) \end{aligned} \quad \square$$

### Bemerkung 2.2.8.

1. Wir schreiben statt „paarweise disjunkt“ auch kürzer „disjunkt“
2. Satz 2.2.7 überträgt sich auch auf Prämaße, sofern  $\mathcal{A}$  stabil bezüglich Durchschnitt, Vereinigung und Mengendifferenz ist (für (i)-(iv)) und sofern  $\mathcal{A}$  stabil bezüglich abzählbaren Schnitten und Vereinigungen ist (für die verbleibenden Eigenschaften)

**Beispiel 2.2.9** (Dirac-Maß). Sei  $X$  eine Menge,  $\mathcal{A}$  eine  $\sigma$ -Algebra in  $X$  und  $x_0 \in X$ . Wir definieren

$$\delta_{x_0}(A) := \begin{cases} 0 & x_0 \notin A \\ 1 & x_0 \in A \end{cases}$$

Dann ist  $\delta_{x_0}$  ein Maß in  $X$  und wird als *Dirac-Maß* bezeichnet.



**Beispiel 2.2.10.** Sei  $\mathcal{A} := \left\{ A \subseteq \mathbb{R} : A \text{ ist abzählbar oder } A^c \text{ ist abzählbar} \right\}$ . Dann ist  $\mathcal{A}$  nach Beispiel 2.1.3 (d) eine  $\sigma$ -Algebra in  $\mathbb{R}$ . Wir definieren ein Maß auf  $\mathcal{A}$  mit

$$\mu(A) := \begin{cases} 0 & A \text{ ist abzählbar} \\ 1 & A \text{ ist nicht abzählbar} \end{cases}$$

**Beispiel 2.2.11** (Zählmaß). Sei  $(X, \mathcal{A})$  ein Messraum. Dann definieren wir das Zählmaß

$$|A| := \begin{cases} \#A & \text{falls } A \text{ endlich} \\ \infty & \text{falls } A \text{ unendlich} \end{cases}$$

wobei  $\#A$  die Anzahl an Elemente in  $A$  angibt.

**Beispiel 2.2.12** (Diskretes W-Maß). Sei  $\Omega = \{\omega_1, \omega_2, \dots\}$  eine abzählbare Menge,  $\mathcal{A} = \mathcal{P}(\Omega)$  und  $(p_n)_{n \in \mathbb{N}} \subseteq [0, 1]$  mit  $\sum_{n \in \mathbb{N}} p_n = 1$ . Dann ist

$$\mathbb{P}(A) := \sum_{n \in \mathbb{N}: \omega_n \in A} p_n = \sum_{n \in \mathbb{N}} p_n \delta_{\omega_n}(A)$$

ein sogenanntes diskretes W-Maß. Der Raum  $(\Omega, \mathcal{A}, \mathbb{P})$  heißt diskreter W-Raum.

[28. Okt] **Bemerkung 2.2.13** (Ring und Algebra). Ein Mengensystem  $R \subseteq \mathcal{P}(X)$  heißt Ring, wenn folgende Eigenschaften erfüllt sind

$$(R_1) \quad \emptyset \in R$$

$$(R_2) \quad A, B \subseteq R \Rightarrow (A \setminus B) \in R$$

$$(R_3) \quad A, B \subseteq R \Rightarrow (A \cup B) \in R$$

Ist ferner  $X \in R$ , dann heißt  $R$  Algebra.

**Bemerkung 2.2.14** (Eigenschaften von Mengenringen). Es sei  $R$  ein Mengenring. Dann gilt

1. Nach der Mengengleichheit  $A \cap B = A \setminus (A \setminus B)$  enthält  $R$  auch Schnitte.
2. Wir definieren die symmetrische Mengendifferenz  $\Delta : R \times R \rightarrow R$ ,  $(A, B) \mapsto (A \setminus B) \cup (B \setminus A)$ . Dann definiert  $(R, \Delta, \cap)$  einen kommutativen Ring im Sinne der Algebra, wobei  $\Delta$  der „Addition“ und  $\cap$  der „Multiplikation“ entspricht.

### 3 [\*] Dynkingsysteme

**Definition 3.1.1** (Dynkingsystem). Ein Mengensystem  $\mathcal{D} \subseteq \mathcal{P}(X)$  heißt Dynkingsystem, falls

$$(D_1) \quad X \in \mathcal{D}$$

$$(D_2) \quad D \in \mathcal{D} \Rightarrow D^C \in \mathcal{D}$$

$$(D_3) \quad \text{Für eine paarweise disjunkte Mengenfolge } (D_n)_n \subseteq \mathcal{D} \Rightarrow \bigsqcup_{n \in \mathbb{N}} D_n \in \mathcal{D}$$

**Beispiel 3.1.2.**

1. Jede  $\sigma$ -Algebra ist ein Dynkingsystem.
2. Sei  $X$  eine  $2n$ -elementige Menge. Dann ist  $\mathcal{D} := \{A \subseteq X : A \text{ hat eine gerade Anzahl an Elementen}\}$  ein Dynkingsystem, aber keine  $\sigma$ -Algebra.

**Lemma 3.1.3.** Sei  $I$  eine beliebige Indexmenge und  $(\mathcal{D}_j)_{j \in I}$  eine Familie von Dynkingsystemen in  $X$ , dann ist  $\bigcap_{j \in I} \mathcal{D}_j$  wieder ein Dynkingsystem.

*Beweis.* (Übung) □

**Satz 3.1.4.** Sei  $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{P}(X)$ . Dann existiert das kleinste Dynkingsystem  $\delta(\mathcal{G})$ , welches  $\mathcal{G}$  enthält. Wir nennen  $\delta(\mathcal{G})$  das von  $\mathcal{G}$  erzeugte Dynkingsystem.

*Beweis.*  $\mathcal{P}(X)$  ist ein Dynkingsystem. Wir definieren also

$$I = \{\mathcal{D} \subseteq \mathcal{P}(X) : \mathcal{D} \text{ ist ein Dynkingsystem und } \mathcal{G} \subseteq \mathcal{D}\} \neq \emptyset$$

Anschließend setzen wir analog zum Schnitt über  $\sigma$ -Algebren

$$\delta(\mathcal{G}) := \bigcap_{\mathcal{D} \in I} \mathcal{D} \quad \square$$

**Definition 3.1.5.** Sei  $\mathcal{D} \subseteq \mathcal{P}(X)$ . Wir nennen  $\mathcal{D}$   $\cap$ -stabil, falls  $A, B \in \mathcal{D} \Rightarrow (A \cap B) \in \mathcal{D}$ . Analog dazu nennen wir  $\mathcal{D}$   $\cup$ -stabil, falls  $A, B \in \mathcal{D} \Rightarrow (A \cup B) \in \mathcal{D}$ .

Frage: Wann ist ein Dynkingsystem eine  $\sigma$ -Algebra?

**Lemma 3.1.6.** Sei  $\mathcal{D}$  ein Dynkingsystem. Dann gilt  $\mathcal{D}$  ist genau dann eine  $\sigma$ -Algebra, wenn  $A, B \in \mathcal{D} \Rightarrow (A \cap B) \in \mathcal{D}$ .

*Beweis.* „ $\Rightarrow$ “ Sei  $\mathcal{D}$  eine  $\sigma$ -Algebra. Dann ist  $\mathcal{D}$  ein Dynkingsystem. Seien  $A, B \in \mathcal{D}$ . Dann folgt  $A^C, B^C \in \mathcal{D} \Rightarrow A \cap B = (A^C \cup B^C)^C \in \mathcal{D}$ .

„ $\Leftarrow$ “ Zu zeigen ist Eigenschaft  $(\Sigma_3)$ . Sei  $(D_n)_n \subseteq \mathcal{D}$  eine Mengenfolge. Wir definieren  $D'_0 := \emptyset$  und  $D'_n := D_1 \cup D_2 \cup \dots \cup D_n$ . Dann ist  $(D'_n)_n$  eine aufsteigende Folge und es gilt

$$\bigcup_{n \in \mathbb{N}} D_n = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} D'_n = \bigsqcup_{n \in \mathbb{N}} (D'_n \setminus D'_{n-1})$$

Außerdem ist

$$\bigsqcup_{n \in \mathbb{N}} (D'_n \setminus D'_{n-1}) \in \mathcal{D} \text{ falls } (D'_n \setminus D'_{n-1}) \in \mathcal{D} \quad \forall n \in \mathbb{N}$$

Und es gilt  $D'_n \setminus D'_{n-1} = (D'_n \cap (D'_{n-1})^c) \in \mathcal{D}$ , falls  $D'_n \in \mathcal{D} \forall n \in \mathbb{N}_0$ . Wir haben also unsere Behauptung gezeigt, wenn wir gezeigt haben, dass  $\mathcal{D}$   $\cup$ -stabil ist. Es gilt aber

$$A \cup B = (A^c \cap B^c)^c \in \mathcal{D}$$

Damit ist  $(\Sigma_3)$  gezeigt. □

**Satz 3.1.7.** Sei  $X$  eine beliebige Menge und  $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{P}(X)$ . Dann folgt aus  $\mathcal{G}$  ist  $\cap$ -stabil, dass  $\delta(\mathcal{G})$   $\cap$ -stabil ist.

*Beweis.* Wir nehmen ein beliebiges  $D \in \delta(\mathcal{G})$  und definieren

$$\mathcal{D}_D := \{Q \in \mathcal{P}(X) : Q \cap D \in \delta(\mathcal{G})\}$$

Behauptung:  $\mathcal{D}_D$  ist ein Dynkinsystem. Stimmt diese Behauptung, dann können wir folgendermaßen argumentieren: Da  $\mathcal{G}$   $\cap$ -stabil ist, gilt

$$\begin{aligned} \forall G, D \in \mathcal{G} : G \cap D \in \mathcal{G} &\subseteq \delta(\mathcal{G}) \\ \Leftrightarrow \forall D \in \mathcal{G} : \mathcal{G} &\subseteq \mathcal{D}_D \\ \Rightarrow \forall D \in \mathcal{G} : \delta(\mathcal{G}) &\subseteq \delta(\mathcal{D}_D) \stackrel{(\text{Beh.})}{=} \mathcal{D}_D \\ \Leftrightarrow \forall D \in \mathcal{G} \forall G \in \delta(\mathcal{G}) : G \cap D &\in \delta(\mathcal{G}) \end{aligned}$$

Aus Symmetriegründen gilt dann

$$\begin{aligned} \forall G \in \delta(\mathcal{G}) \forall D \in \mathcal{G} : D \cap G &= G \cap D \in \delta(\mathcal{G}) \\ \Leftrightarrow \forall G \in \delta(\mathcal{G}) : \mathcal{G} &\subseteq \mathcal{D}_G \\ \Rightarrow \delta(\mathcal{G}) &\subseteq \delta(\mathcal{D}_G) = \mathcal{D}_G \quad \forall G \in \delta(\mathcal{G}) \\ \Leftrightarrow \forall D, G \in \delta(\mathcal{G}) : D \cap G &\in \delta(\mathcal{G}) \end{aligned}$$

Das heißt  $\delta(\mathcal{G})$  ist  $\sigma$ -stabil.

Wir zeigen noch die Behauptung:

(D<sub>1</sub>) Da  $X \cap D = D \in \delta(\mathcal{G})$  folgt  $X \in \mathcal{D}_D$ .

(D<sub>2</sub>) Sei  $Q \in \mathcal{D}_D$ . Dann ist auch  $Q^c \in \mathcal{D}_D$ , denn  $Q^c \cap D = (Q^c \cup D^c) \cap D = (Q \cap D)^c \cap D = D \setminus (Q \cap D) \in \delta(\mathcal{G})$ .

(D<sub>3</sub>) (Fehlt, siehe handschriftliches Skript) □

**Korollar 3.1.8.** Sei  $X$  eine beliebige Menge und  $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{P}(X)$ . Wenn  $\mathcal{G}$   $\cap$ -stabil ist, dann ist  $\delta(\mathcal{G})$  eine  $\sigma$ -Algebra und es gilt  $\sigma(\mathcal{G}) = \delta(\mathcal{G})$ .

*Beweis.* Nach Satz 3.1.7 ist  $\delta(\mathcal{G})$   $\cap$ -stabil und damit nach Lemma 3.1.6 eine  $\sigma$ -Algebra. Damit gilt dann  $\sigma(\mathcal{G}) \subseteq \delta(\mathcal{G})$ , da  $\sigma(\mathcal{G})$  die kleinste  $\sigma$ -Algebra ist, die  $\mathcal{G}$  enthält. Außerdem ist  $\delta(\mathcal{G}) \subseteq \delta(\sigma(\mathcal{G})) = \sigma(\mathcal{G})$ . □

## 4 [\*] Eindeutigkeit von Maßen und erste Eigenschaften des Lebesgue-Maßes

[04. Nov] **Satz 4.1.1** (Eindeutigkeitssatz). Sei  $(X, \mathcal{A})$  ein beliebiger Messraum und  $\mathcal{A} = \sigma(\mathcal{E})$  für  $\mathcal{E} \subseteq \mathcal{P}(X)$ . Ferner seien  $\mu, \nu$  Maße auf  $\mathcal{A}$  mit

- (a)  $\mathcal{E}$  ist  $\cap$ -stabil
- (b) Es gibt Mengen  $G_n \in \mathcal{E}$  mit  $G_n \nearrow X$  ( $X = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} G_n$ ) mit  $\mu(G_n), \nu(G_n) < \infty \forall n \in \mathbb{N}$

Dann gilt: Aus  $\mu(A) = \nu(A) \forall A \in \mathcal{E}$  folgt  $\mu = \nu$  auf  $\mathcal{A}$ . Das heißt unter den obigen Voraussetzungen wird ein Maß eindeutig durch seine Werte auf dem Erzeuger definiert.

*Beweis.* Da  $\mathcal{E}$   $\cap$ -stabil ist, folgt nach Korollar 3.1.8, dass  $\delta(\mathcal{E}) = \sigma(\mathcal{E}) = \mathcal{A}$ . Wir halten  $n \in \mathbb{N}$  fest und betrachten

$$\mathcal{D}_n := \{A \in \mathcal{A} : \mu(G_n \cap A) = \nu(G_n \cap A)\}$$

$\mathcal{D}_n$  ist ein Dynkinsystem:

(D<sub>1</sub>) Folgt direkt.

(D<sub>2</sub>) Sei  $A \in \mathcal{D}_n$ . Dann ist

$$\begin{aligned} \mu(G_n \cap A^c) &= \mu(G_n \setminus A) = \mu(G_n \setminus (A \cap G_n)) \\ &= \mu(G_n) - \mu(A \cap G_n) \\ &= \nu(G_n) - \nu(A \cap G_n) \\ &= \nu(G_n \cap A^c) \\ &\Rightarrow A^c \in \mathcal{D}_n \end{aligned}$$

(D<sub>3</sub>) Sei  $(A_m)_m \subseteq \mathcal{D}_n$  eine Folge paarweise disjunkter Mengen. Dann gilt

$$\begin{aligned} \mu\left(\left(\bigsqcup_{m \in \mathbb{N}} A_m\right) \cap G_n\right) &= \mu\left(\bigsqcup_{m \in \mathbb{N}} (A_m \cap G_n)\right) = \sum_{m \in \mathbb{N}} \mu(A_m \cap G_n) \\ &= \sum_{m \in \mathbb{N}} \nu(A_m \cap G_n) = \nu\left(\left(\bigsqcup_{m \in \mathbb{N}} A_m\right) \cap G_n\right) \\ &\Rightarrow \bigsqcup_{m \in \mathbb{N}} A_m \in \mathcal{D}_n \end{aligned}$$

Nach Konstruktion von  $\mathcal{D}_n$  gilt  $\mathcal{D}_n \subseteq \mathcal{A}$ . Andererseits ist  $\mathcal{E} \subseteq \mathcal{D}_n$ . Sei  $A \in \mathcal{E}$  und  $A \cap G_n \in \mathcal{E}$ , da  $\mathcal{E}$   $\cap$ -stabil. Nach Voraussetzung gilt  $\nu(A \cap G_n) = \mu(A \cap G_n)$ , also folgt  $A \in \mathcal{D}_n$ .

Da  $\mathcal{E} \subseteq \mathcal{D}_n \Rightarrow \sigma(\mathcal{E}) \subseteq \delta(\mathcal{E}) = \mathcal{D}_n$ . Damit gilt  $\sigma(\mathcal{E}) \subseteq \mathcal{D}_n$ . Das heißt  $\forall A \in \sigma(\mathcal{E})$  folgt  $\mu(A \cap G_n) = \nu(A \cap G_n)$ .

Für  $A \in \sigma(\mathcal{E})$  definieren wir eine aufsteigende Folge  $A_n := A \cap G_n \nearrow A$ . Da  $\mu, \nu$  Maße sind, sind sie von unten stetig. Das heißt

$$\begin{aligned} \mu(A) &= \lim_{n \rightarrow \infty} \mu(A_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} \mu(A \cap G_n) \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} \nu(A \cap G_n) = \nu(A) \end{aligned}$$

□

**Bemerkung 4.1.2** (Ausschöpfende Folgen). Wir nennen  $(G_n)_n$  im Sinne von Satz 4.1.1 eine ausschöpfende Folge. Wir nennen ein Maß  $\mu$  auf  $\mathcal{A}$   $\sigma$ -endlich, wenn es eine Folge  $(G_n)_n \subseteq \mathcal{A}$  gibt mit  $G_n \nearrow X$  und  $\mu(G_n) < \infty \forall n \in \mathbb{N}$ .

**Satz 4.1.3** (Eigenschaften der Borelmengen). In Definition 2.1.8 hatten wir  $\mathcal{B}(\mathbb{R}^d) := \sigma(\mathcal{O}_d)$ , wobei  $\mathcal{O}$  das System offener Teilmengen im  $\mathbb{R}^d$  war. Wir definieren nun

- $\mathcal{A}_d$ : System der abgeschlossenen Teilmengen im  $\mathbb{R}^d$
- $\mathcal{K}_d$ : System der kompakten Teilmengen in  $\mathbb{R}^d$

Dann gilt  $\sigma(\mathcal{K}_d) = \sigma(\mathcal{A}_d) = \sigma(\mathcal{O}_d) = \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$ .

*Beweis.* SCHRITT 1:  $\sigma(\mathcal{A}_d) = \sigma(\mathcal{O}_d)$  ist klar, da  $\sigma$ -Algebren stabil unter Komplementbildung sind.

SCHRITT 2: Es gilt  $\mathcal{K}_d \subseteq \mathcal{A}_d \Rightarrow \sigma(\mathcal{K}_d) \subseteq \sigma(\mathcal{A}_d)$ .

SCHRITT 3: Für  $n \in \mathbb{N}$  definieren wir  $K_n := \{|x| < n\}$ . Sei  $A \in \mathcal{A}_d$ , dann ist  $A \cap K_n$  kompakt und

$$\begin{aligned} \bigcup_{n \in \mathbb{N}} K_n &= \mathbb{R}^d \\ A &= \bigcup_{n \in \mathbb{N}} (A \cap K_n) \in \sigma(\mathcal{K}_d) \\ &\Rightarrow \mathcal{A} \subseteq \sigma(\mathcal{K}_d) \\ &\Rightarrow \sigma(\mathcal{A}_d) \subseteq \sigma(\sigma(\mathcal{K}_d)) = \sigma(\mathcal{K}_d) \\ &\Rightarrow \sigma(\mathcal{K}_d) = \sigma(\mathcal{A}_d) = \sigma(\mathcal{O}_d) \end{aligned}$$

□

Im Folgenden nehmen wir an, dass das Lebesgue-Maß  $\lambda^d$  auf  $\mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$  existiert. Wir werden das später noch beweisen, aber entwickeln das Maß nun nach unserem geometrischen Verständnis unter der Annahme, dass es existiert (das tut es) und untersuchen erste Eigenschaften:

**Beobachtung 4.1.4.** Wir betrachten den Fall  $d = 1$  und ein halboffenes Intervall  $I := [a, b)$ . Dann muss gelten  $\lambda^1(I) = b - a$ . Wir betrachten allgemeine  $d$  mit  $a, b \in \mathbb{R}^d$  wobei  $a \leq b$  (das heißt  $a_j \leq b_j$ ). Dann sei

$$[a, b) := \left\{ x \in \mathbb{R}^d : a_j \leq x_j \leq b_j \forall j \in \{1, \dots, d\} \right\}$$

und wir definieren nach unserem geometrischen Verständnis

$$\lambda^d([a, b)) := \prod_{j=1}^d (b_j - a_j)$$

**Definition 4.1.5.** Es sei  $J^d := \{[a, b) : a, b \in \mathbb{R}^d, a \leq b\}$  das Mengensystem der halboffenen Intervalle im  $\mathbb{R}^d$ .

**Bemerkung 4.1.6** (Translationsinvarianz des Lebesgue-Maß). Es sei  $c \in \mathbb{R}^d$  und wir definieren eine Translation  $T_c(x) := x + c$  mit inverser Funktion  $T_c^{-1}$ . Dann gilt für ein halboffenes Intervall  $I := [a, b)$

$$\begin{aligned} \lambda^d(T_c^{-1}(I)) &= \lambda^d([a - c, b - c)) \\ &= \prod_{j=1}^d (b_j - c_j - (a_j - c_j)) \end{aligned}$$

$$= \prod_{j=1}^d (b_j - a_j) = \lambda^d(I)$$

Das heißt auf  $J^d$  ist  $\lambda^d$  invariant unter Translation.

**Lemma 4.1.7.** Sei  $B \in \mathcal{B}^d$  eine Borelmenge und  $c \in \mathbb{R}^d$ . Dann ist  $B + c := \{b + c : b \in B\} \in \mathcal{B}^d$ .

*Beweis.* Sei  $c \in \mathbb{R}^d$  fest. SCHRITT 1: Wir wenden das „Wünsch-dir-was“-Vorgehen an und definieren

$$\mathcal{A} := \left\{ A \in \mathcal{B}^d : A + c \in \mathcal{B}^d \right\}$$

Dann ist  $\mathcal{A}$  eine  $\sigma$ -Algebra (Übung).

SCHRITT 2:  $\mathcal{O}_d$  ist translationsinvariant. Das heißt  $\mathcal{O}_d \in \mathcal{A} \Rightarrow \mathcal{B}^d = \sigma(\mathcal{O}_d) \subseteq \sigma(\mathcal{A}) = \mathcal{A}$ . Das heißt  $\mathcal{B}^d \subseteq \mathcal{A}$ . Damit sind die Borelmengen translationsinvariant.  $\square$