

## 1er cours

**Exercice 1.** Soit  $A, B \subseteq E$ , montrer que pour tout  $x \in E$ ,

$$\mathbf{1}_{A \cup B} = \mathbf{1}_A + \mathbf{1}_B - \mathbf{1}_{A \cap B}$$

Soit  $A_1 \subseteq A_2 \subseteq \dots$

$$\lim_k \mathbf{1}_{A_k(x)} = \mathbf{1}_{\{x \text{ est dans tous les } A_k\}}$$

**Réponse :**  $\mathbf{1}_{A \cup B}$  : voir TD1.

$\lim_k \mathbf{1}_{A_k}(x) = 1$  ssi à partir d'un certain rang  $k \geq 1$ ,  $x$  est dans  $A_k$ , car par inclusion il sera ensuite dans tous les  $A_n, n \geq k$ . Donc

$$\lim_k \mathbf{1}_{A_k} = \mathbf{1}_{\cup_k A_k}.$$

**Exercice 2.** On a pour toute famille dénombrable d'ensembles  $\{A_i; i \in I\}$

$$\bigcap_{i \in I} A_i = \left( \bigcup_{i \in I} A_i^c \right)^c$$

Montrer alors que (i)+(ii)+(iii)  $\Leftrightarrow$  (i) + (ii) + (iii').

**Réponse :**

$$\begin{aligned} x \in \bigcap_i A_i &\Leftrightarrow \forall i, x \in A_i, \\ &\Leftrightarrow \text{non}(\exists i, x \notin A_i) \\ &\Leftrightarrow \text{non}(x \in \bigcup_i A_i^c) \\ &\Leftrightarrow x \in (\bigcup_i A_i^c)^c \end{aligned}$$

Dés lors, si  $\mathcal{A} \subset \mathcal{P}(E)$  vérifie (i)+(ii)+(iii'), pour  $A_n, n \geq 1$  dans  $\mathcal{A}$ , on a par (ii) et (iii') que  $\bigcap_n A_n^c \in \mathcal{A}$ , et donc encore par (ii) que

$$\left( \bigcap_n A_n^c \right)^c \in \mathcal{A},$$

càd (iii) :  $\bigcup_n A_n \in \mathcal{A}$ . On a donc prouvé (i)+(ii)+(iii') implique (i)+(ii)+(iii). La réciproque est similaire.

**Exercice 3.**

**Proposition 1** (Restriction). Soit  $(E, \mathcal{A})$  un ensemble mesurable et soit  $E' \subseteq E$  un sous-ensemble de  $E$  (non-nécessairement mesurable). Alors

$$\mathcal{A} \cap E' = \{A \cap E' : A \in \mathcal{A}\}$$

est une tribu sur  $E'$ , appelée tribu trace. On note parfois simplement  $(E', \mathcal{A} \cap E') = (E', \mathcal{A})$ .

**Preuve :** On note  $\mathcal{A}' = \mathcal{A} \cap E'$ .

- (i)  $\emptyset = \emptyset \cap E' \in \mathcal{A}'$
- (ii) Soit  $A \in \mathcal{A} \cap E'$ , alors il existe  $B \in \mathcal{A}$  tel que  $A = B \cap E'$ , et donc le complémentaire de  $A$  dans  $E'$  est

$$B^c \cap E' \in \mathcal{A}'$$

donc le complémentaire de  $A$  dans  $E'$  est dans  $\mathcal{A}'$

– (iii) Soit  $A_n, n \geq 1 \in \mathcal{A}'$  et  $B_n; n \geq 1$  tq  $A_n = B_n \cap E'$ . Alors

$$\cup_n A_n = \cup_n (B_n \cap E') = (\cup_n B_n) \cap E' \in \mathcal{A}'$$

car  $\cup_n B_n \in \mathcal{A}$  par (iii)

### 2ème cours

**Exercice 4.** Si  $f = \mathbf{1}_A : E \mapsto (\mathbb{R}, \mathcal{P}(\mathbb{R}))$ , on a

$$\sigma(f) = \sigma(\{A\}) = \{\emptyset, A, A^c, E\}.$$

*Démonstration.* Pour tout borélien  $B \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$ ,

$$f^{-1}(B) \in \{\emptyset \text{ (si } 0 \notin B, 1 \notin B) \text{ , } A \text{ (si } 0 \notin B, 1 \in B) \text{ , } A^c \text{ si } 0 \in B, 1 \notin B) \text{ , } E \text{ (si } 0 \in B, 1 \in B) \}.$$

□

**Exemple 2.**  $E = [1, +\infty[, F = ]0, 1]$

$$\mathcal{C} = \{]0, 1/3], ]1/3, 2/3], ]2/3, 1]\} \subset \mathcal{P}(F).$$

Déterminer  $\sigma(\mathcal{C})$ .

$f(x) = 1/x$ . Déterminer  $\sigma(f)$  relativement à  $\sigma(\mathcal{C})$ .

Montrer que

$$\sigma(f) = \sigma(f^{-1}(]0, 1/3]), f^{-1}(]1/3, 2/3]), f^{-1}(, ]2/3, 1])$$

càd que

$$f^{-1}(\sigma(\mathcal{C})) = \sigma(f^{-1}(\mathcal{C}))$$

*Démonstration.*

$$\sigma(\mathcal{C}) = \mathcal{C} \cup \{\emptyset, F, ]0, 2/3], ]1/3, 1], ]0, 1/3] \cup ]2/3, 1]\}.$$

$$\sigma(f) = f^{-1}(\sigma(\mathcal{C})) = \{f^{-1}(\emptyset), f^{-1}(F), f^{-1}(]0, 1/3]), f^{-1}(]1/3, 2/3]), \text{etc...}\} = \{\emptyset, E, ]3, +\infty[, ]3/2, 3], \text{etc...}\}$$

Il suffit de remarquer pour conclure que

$$\{\emptyset, E, ]3, +\infty[, ]3/2, 3], \text{etc...}\} = \sigma(f^{-1}(]0, 1/3]), f^{-1}(]1/3, 2/3]), f^{-1}(, ]2/3, 1])$$

□

**Exercice 5.** Donner d'autres caractérisations similaires de la mesurabilité des fonctions réelles.

$$\mathcal{B}(\mathbb{R}) = \sigma([a, b[; a < b) = \sigma(]a, b], a < b) = \sigma(]-\infty, a], a \in \mathbb{R}) = \sigma(]-\infty, a[, a \in \mathbb{R})$$

**Exercice 6.** Toujours vrai si on remplace  $a, b \in \mathbb{R}$  par  $a, b \in \mathbb{Q}$ . (Pour  $a < b$ , il existe  $(a_k)_{k \geq 1}$  tq  $a_k \uparrow a$  etc...)

*Démonstration.* Soit  $[a, b] \in \mathbb{R}$ , et  $(a_k)_{k \geq 1}$  une suite de rationnels  $\leq a$  qui converge vers  $a$ , et  $(b_k)_{k \geq 1}$  une suite de rationnels  $\geq b$  convergant vers  $b$ . Alors

$$[a, b] = \bigcap_{k \geq 1} [a_k, b_k]$$

ce qui prouve que

$$[a, b] \subset \sigma([a', b'], a' < b' \in \mathbb{Q}).$$

□

### 3ème cours

**Exercice 7.** Si on n'imposait pas l'axiome (ii), l'unique autre mesure possible serait

$$\mu : A \mapsto +\infty.$$

*Démonstration.* Soit  $\mu$  une application qui vérifie *i* et pas *ii*. Soit  $a = \mu(\emptyset) \neq 0$ . Alors

$$a = \mu(\emptyset) = \mu(\emptyset \cup \emptyset) = 2\mu(\emptyset) = 2a, \text{ donc } a = +\infty.$$

Il s'en suit que pour tout mesurable  $A$ ,  $\emptyset \subset A$  donc  $\mu(A) \geq \mu(\emptyset) \geq +\infty$ . □

**Exercice 8.** Donner une expression de  $\mu(A \cup B \cup C)$  (on pourra s'inspirer des résultats sur les indicatrices).

*Démonstration.*

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

□

**Exercice 9.** Si  $A_1 \supset A_2 \dots$  et l'un des  $A_n$  a une mesure finie, montrer que

$$\mu\left(\bigcap_n A_n\right) = \lim_n \downarrow \mu(A_n)$$

Contre-exemple sur  $\mathbb{N}$  avec  $A_n = [n, \infty]$ .

*Démonstration.* Soit  $n_0$  tel que  $\mu(A_{n_0}) < \infty$ . Pour  $n \geq n_0$ , soit

$$B_n = A_{n_0} \setminus A_n,$$

comme  $\mu(A_n) \leq \mu(A_{n_0}) < \infty$ ,

$$\mu(B_n) = \mu(A_{n_0}) - \mu(A_n).$$

Comme  $\cup_n B_n$  est une union croissante,

$$\mu(\cup_n B_n) = \lim_n \uparrow \mu(B_n)$$

càd

$$\mu(A_{n_0}) - \mu(\cap_n A_n) = \mu(A_{n_0}) - \lim_n \mu(A_n)$$

□

**Exemples 3** (Masses de Dirac). 1. Soit  $E = \mathbb{R}$ , muni des Boréliens. Soit  $x \in \mathbb{R}$ , et

$$\delta_x(A) = 1_{x \in A}.$$

Montrer que c'est une mesure.  $\delta_x$  s'appelle masse de Dirac en  $x$ .

2. Soit  $(c_i)_{i \in I}$  une famille de nombres réels, et  $(x_i)_{i \in I}$  une famille de réels. Soit

$$\mu = \sum_{i \in I} c_i \delta_{x_i}.$$

On rappelle qu'une somme arbitraire de nombres positifs vaut

$$\sum_{i \in I} c_i = \begin{cases} +\infty & \text{si } I \text{ n'est pas dénombrable} \\ \sum_{k \geq 1} c_{i_k} & \text{si } I = \{i_1, i_2, \dots\} \text{ est dénombrable.} \end{cases}$$

Montrer que  $\mu$  est bien une mesure.

**Exercice 10.** avec les notations de 3. Soit  $A = [1, 1000]$ ,  $c_k = \alpha^k$ ,  $x_k = k$ ,  $k \geq 1$  pour  $\alpha > 0$ .

**Exercice 11.** Montrer que  $(\mathbb{R}, \mathcal{P}(\mathbb{R}), \mu_{\text{comptage}})$  n'est pas  $\sigma$ -finie.

**Exercice 12.** Calculer  $f(x) = \limsup_n (-1)^{[nx]}$ ,  $g(x) = \liminf_n (-1)^{[nx]}$ .

*Démonstration.* Pour  $y \in \mathbb{R}$ , il existe un unique entier  $k \in \mathbb{Z}$  et un unique nombre de  $[0, 2[$  noté  $\{y\}$  tel que

$$y = 2k + \{y\}.$$

Et on a

$$(-1)^y = \begin{cases} 1 & \text{si } \{y\} \in [0, 1[ \\ -1 & \text{si } \{y\} \in [1, 2[. \end{cases}$$

Soit  $x \in \mathbb{R}$ . Si  $\{x\}$  est irrationnel, alors  $\{nx; n \in \mathbb{N}\}$  est dense dans  $[0, 2[$ , et donc il y a une infinité de  $n$  pour lesquels  $[nx]$  est pair et une infinité de  $n$  pour lesquels il est impair. Ainsi on a

$$\begin{aligned} \limsup f_n(x) &= f(x) = 1 \\ \liminf f_n(x) &= g(x) = -1. \end{aligned}$$

Supposons maintenant  $\{x\} = \frac{p}{q}$  pour des entiers  $p$  et  $q$  premiers entre eux. Remarquons tout d'abord que l'infinité de valeurs  $\{2nqx = 2np; n \geq 1\} = 0$  assure  $f(x) = 1$ . Il reste à déterminer la  $\liminf$ . Alors  $\{nx : n \in \mathbb{N}\} = \{np/q; n \in \mathbb{N}\}$  prend ses valeurs dans  $\{k/q; 0 \leq k < 2q\}$ , assimilé au groupe  $(\mathbb{Z} \setminus 2q\mathbb{Z}, +)$ . A moins que  $p = 0$  dans  $\mathbb{Z}/2q\mathbb{Z}$ , la suite  $(kp)_{k \geq 1}$  passe une infinité de fois par  $\{q+1, \dots, 2q-1\}$  dans  $\mathbb{Z}/2q\mathbb{Z}$ . En définitive, à moins que  $p = 0$ ,  $g(x) = -1$ . Le cas  $p = 0$  correspond au cas où  $x = 2k$  pour un certain entier  $k \in \mathbb{Z}$ . On a dans ce cas  $\limsup_n (-1)^{2nk} = 1$ . En définitive

$$\begin{aligned} f(x) &= 1, x \in \mathbb{R} \\ g(x) &= \begin{cases} 1 & \text{si } x \text{ est un entier pair,} \\ -1 & \text{sinon.} \end{cases} \end{aligned}$$

□

#### 4ème cours

**Exemple 4.** Soit  $f(x)$  =partie entière de  $x$ . En décomposant  $f$  sous sa forme canonique, calculer

$$\int_{[0,5]} f(x)\lambda(dx)$$

*Démonstration.* On a sur  $[0, 5]$

$$f = \sum_{k=0}^5 k 1_{[k,k+1[}$$

donc  $f$  est e.m.p. On a par définition

$$\int_{[0,5]} f d\lambda = \sum_{k=0}^5 k \mu([0, 5] \cap [k, k + 1]) = \sum_{k=0}^4 k = 1 + 2 + 3 + 4 = 10.$$

□

**Exercice 13.** Montrer croissance de l'intégrale pour les fonctions e.m.p

*Démonstration.* Soit  $f$  et  $g$  des fonctions e.m.p telles que  $f \leq g$ . Soit  $\alpha_i, i = 1, \dots, p$  les valeurs prises par  $f$ , et  $\beta_j, j = 1, \dots, q$  les valeurs prises par  $g$ . Alors  $g - f$  prend ses valeurs dans  $\{(\alpha_i - \beta_j, 1 \leq i \leq p, 1 \leq j \leq q)\}$ , qui est fini, et  $f$  est mesurable comme différence de fonctions linéaires. Donc  $f - g$  est e.m.p., et on a

$$\int f d\mu + \int (g - f) d\mu = \int g d\mu$$

d'où  $\int f \leq \int g$ .

□

## 5ème cours

**Exercice 14.** Montrer par un contre-exemple qu'on ne peut pas définir l'intégrale d'une f.m.p.  $f$  comme

$$\int_E f d\mu := \inf_{h \geq f, h \text{ étagée}} \int h d\mu$$

*Démonstration.* Soit  $f(x) = \frac{1}{x^2} 1_{x \neq 0}$ . Soit  $h$  une fonction étagée positive  $\geq f$  sur  $\mathbb{R}$ . Alors

$$h = \sum_i \alpha_i 1_{A_i}$$

pour une partition  $(A_i), i = 1, \dots, q$  de  $\mathbb{R}$  et des réels  $\alpha_i$ . Il existe au moins un  $A_{i_0}$  de mesure de Lebesgue infinie car

$$\sum_{i=1}^q \lambda(A_i) = \lambda(\mathbb{R}) = +\infty.$$

On a alors

$$\int h d\mu \geq \alpha_{i_0} \mu(A_{i_0})$$

avec (comme  $h \geq f$ )

$$\alpha_{i_0} \geq \sup_{x \in A_{i_0}} \frac{1}{x^2} > 0,$$

d'où

$$\int h d\lambda = +\infty.$$

On aboutit à

$$\int_{\mathbb{R}^*} \frac{1}{x^2} dx = +\infty,$$

ce qui est faux. □

**Exercice 15.** Pour  $f$  intégrable,  $\lambda \in \mathbb{R}$ ,  $\int \lambda f = \lambda \int f$

- (Croissance).
- (Linéarité en la mesure)

$$\int f d(\mu + \mu') = \int f_+ d(\mu + \mu') - \int f_- d(\mu + \mu')$$

*Démonstration.* 1. On a

$$\int \lambda f = \int \lambda(f^+ - f^-) = \int \lambda f^+ - \int \lambda f^- = \lambda \int f^+ - \lambda \int f^-$$

2. Si  $f \leq g$ ,  $g - f$  est une fonction mesurable positive, donc

$$\int f = \int g - \int (g - f) \leq \int g.$$

3. On a

$$\begin{aligned} \int f d(\mu + \mu') &= \int (f^+ - f^-) d(\mu + \mu') = \int f^+ d(\mu + \mu') - \int f^- d(\mu + \mu') \\ &= \int f^+ d\mu + \int f^+ d\mu' - \int f^- d\mu - \int f^- d\mu' = \int (f^+ - f^-) d\mu + \int (f^+ - f^-) d\mu' = \int f d\mu + \int f d\mu'. \end{aligned}$$

□

**Proposition 5.** Soit  $I$  un ensemble dénombrable, et  $N_i, i \in I$  une famille d'ensembles négligeables. Montrer que  $\cup_{i \in I} N_i$  est négligeable. De même si les  $A_i$  sont de mesure complète, alors  $\cap A_i$  également.

Donner un contre exemple si  $I$  est indénombrable.

*Démonstration.* On a

$$\mu(\cup_i N_i) \leq \sum_{i \in I} \mu(N_i) = 0$$

car  $I$  est dénombrable. On a

$$\mu((\cap_i A_i)^c) = \mu(\cup_{i \in I} (A_i^c)) = 0$$

d'après la question précédente (les  $A_i^c$  sont par définition négligeables).

**Contre-exemple :** Avec  $I = \mathbb{R}, N_x = \{x\}$  pour  $x \in I$ ,

$$\lambda(\cup_i N_i) = \lambda(\mathbb{R}) = +\infty.$$

□



**6ème cours**

**Exercice 16.** Phénomène de concentration de la masse.  
 Erreur dans l'énoncé, j'aurais du définir

$$f_n(x) = (n - n^2x)^+, x > 0.$$

(j'ai mis des points aux copies cohérentes) J'aurais alors

$$f_n(x) = \begin{cases} n - n^2x & \text{si } x \in [0, 1/n] \\ 0 & \text{sinon.} \end{cases}$$

Donc pour  $x > 0$ , à partir d'un certain  $n$ ,  $1/n < x$  et donc  $f_n(x) \rightarrow 0$ , donc  $f_n(x) \rightarrow 0$  pour tout  $x$ . et

$$\int_{\mathbb{R}_+} f_n = \int_0^{1/n} (n - n^2x)dx = \frac{1}{n}n - n^2 \int_0^{1/n} xdx = 1 - n^2[x^2/2]_0^{1/n} = 1 - n^2 \frac{1}{2n^2} = \frac{1}{2} \rightarrow \frac{1}{2} \neq 0.$$

**Exercice 17.** Soit une suite de réels  $(u_n)$ . Alors avec

$$\overline{u_n} = \inf_{k \geq n} u_k,$$

$$\liminf u_n = \liminf \overline{u_n} = \lim \overline{u_n}$$

car  $(\overline{u_n})$  est croissante.

*Démonstration.*  $(\overline{u_n})$  est croissante car pour  $n \geq 1$ ,

$$\inf_{k \geq n} u_k \leq \inf_{k \geq n+1} u_k \quad (\text{inf sur un plus petit ensemble}).$$

Donc  $\overline{u_n}$  converge dans  $\overline{\mathbb{R}}_+$ , ce qui implique  $\boxed{\liminf \overline{u_n} = \lim \overline{u_n}}$ . On a aussi trivialement

$$\overline{u_n} \leq u_n \text{ car } \overline{u_n} = \inf(u_n, u_{n+1}, \dots).$$

Donc  $\boxed{\liminf \overline{u_n} \leq \liminf u_n}$ . Dans l'autre sens,  $\lambda = \liminf u_n$  est la plus petite valeur d'adhérence de  $(u_n)$ , donc pour tout  $\varepsilon > 0$ ,  $(u_n)$  n'a qu'un nombre fini de termes plus petits que  $\lambda - \varepsilon$ , donc à partir d'un certain rang  $n_0$  (une fois le rang ayant dépassé cet ensemble fini de termes), pour  $n \geq n_0$ ,

$$\overline{u_n} = \inf_{k \geq n} u_k \geq \lambda - \varepsilon$$

d'où on déduit  $\lim \overline{u_n} \geq \lambda - \varepsilon$  pour tout  $\varepsilon > 0$ , càd  $\boxed{\lim \overline{u_n} \geq \lambda = \liminf u_n}$ . □

**Exercice 18.**  $\mathcal{B}(\mathbb{R}^2) = \mathcal{B}(\mathbb{R})^{\otimes 2}$ .

*Démonstration.* On a dans un sens

$$\mathcal{B}(\mathbb{R}^2) = \sigma([a; b[\times]c, d[; a \leq b, c \leq d \in \mathbb{R}) \subset \sigma(A \times B; A \in \mathcal{B}(\mathbb{R}), B \in \mathcal{B}(\mathbb{R})) = \mathcal{B}(\mathbb{R})^{\otimes 2}$$

car chaque  $]a, b[$  et chaque  $]c, d[$  sont dans  $\mathcal{B}(\mathbb{R})$ . Pour l'autre sens, il faut montrer que chaque  $A \times B \in \mathcal{A} \times \mathcal{B}$  est dans  $\mathcal{B}(\mathbb{R}^2)$  (ainsi  $\mathcal{A} \otimes \mathcal{B} = \sigma(\mathcal{A} \times \mathcal{B})$  sera également inclus dans  $\sigma(\mathcal{B}(\mathbb{R}^2)) = \mathcal{B}(\mathbb{R}^2)$ ). Comme  $A \times B = (A \times \mathbb{R}) \cap (\mathbb{R} \times B)$ , il suffit de montrer  $A \times \mathbb{R} \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^2)$  (idem pour  $\mathbb{R} \times B$ ). Or  $A \times \mathbb{R} = \pi_1^{-1}(A)$  où  $\pi_1(x, y) = x$  est continue, donc  $\mathcal{B}(\mathbb{R}^2)$  mesurable. □

7 ème cours

**Exercice 19.** L'opération  $_x$  permute avec toutes les opérations sur les ensembles

$$\begin{aligned} \left(\bigcap_{i \in I} C_i\right)_x &= \bigcap_i (C_i)_x, \\ \left(\bigcup_{i \in I} C_i\right)_x &= \bigcup_i (C_i)_x, \\ (C_x)^c &= (C^c)_x \\ (C_1 \setminus C_2)_x &= (C_1)_x \setminus (C_2)_x. \end{aligned}$$

*Démonstration.* Soit  $x \in E$ .

$$\begin{aligned} \left(\bigcap_i C_i\right)_x &= \{y : (x, y) \in \bigcap_i C_i\} = \{y : \forall i, (x, y) \in C_i\} = \bigcap_i (C_i)_x \\ (C_1 \setminus C_2)_x &= \{y : (x, y) \in C_1 \setminus C_2\} = \{y : (x, y) \in C_1\} \setminus \{y : (x, y) \in C_2\} = (C_1)_x \setminus (C_2)_x \\ (C_x)^c &= F \setminus (C_x) = (F \setminus C_x) = (F \setminus C)_x = (C^c)_x \\ \left(\bigcup_i C_i\right)_x &= \left(\left(\bigcap_i (C_i^c)\right)^c\right)_x = \left(\left(\bigcap_i (C_i)_x\right)^c\right)_x = \bigcup_i (C_i)_x \end{aligned}$$

□

**Exo :** Vérifions que  $\mu \otimes \nu$  est bien une mesure :

$$\mu(\emptyset) = 0$$

Soit  $(C_n)$  une famille de mesurables de  $\mathcal{A} \otimes \mathcal{B}$  2 à 2 disjoints.

$$\begin{aligned} \mu \otimes \nu(\bigcup_n C_n) &= \int_E \nu(\bigcup_n C_n)_x \mu(dx) = \int_E \nu(\bigcup_n (C_n)_x) \mu(dx) \\ &= \int_E \sum_n \nu((C_n)_x) \mu(dx) \text{ car les } (C_n)_x \text{ sont disjoints } ((C_n)_x \cap (C_m)_x) = (C_n \cap C_m)_x = \emptyset \\ &= \sum_n \int_E \nu((C_n)_x) \mu(dx) \end{aligned}$$

## 8 ème cours

**Exercice 20.**  $E = F = [0, 1]$  muni de  $\mathcal{B}(\overline{\mathbb{R}}) \cap E$  avec boreliens et

$$\int_0^1 \left( \int_0^1 \frac{x^2 - y^2}{(x^2 + y^2)^2} dx \right) dy.$$

Expliquer pourquoi Fubini ne s'applique pas.

*Démonstration.*

$$\begin{aligned} \int_0^1 \left( \int_0^1 |f(x, y)| dx \right) dy &\geq \int_0^1 \left( \int_0^y |f(x, y)| dx \right) dy = \int_0^1 \left( \int_0^1 \frac{y^2 - x^2}{(x^2 + y^2)^2} dx \right) dy \\ &= \int_0^1 \left[ \frac{x}{x^2 + y^2} \right]_0^y dy = \int_0^1 \frac{1}{2y} dy = \infty. \end{aligned}$$

$f$  n'est donc pas intégrable et on ne peut pas appliquer Fubini (pour fonctions quelconques).  $\square$

**Exercice 21.** Montrer que  $\varphi(x, y) = (xy, y)$  est un  $\mathcal{C}^1$ -diffeomorphisme sur

$$E = \{(x, y) : x > 0, y > 0, xy > 1\}.$$

et calculer son jacobien.

(1 point pour le dessin de  $E$ ).

On pose pour  $(x, y) \in E$

$$\begin{aligned} u &= xy > 1 \\ v &= y > 0 \end{aligned}$$

qui amène à

$$\begin{aligned} x &= u/v > 0 \\ y &= v > 0 \end{aligned}$$

On a réciproquement, pour  $(u > 1, v > 0)$ ,

$$\begin{aligned} x &= u/v \\ y &= v \end{aligned}$$

vérifie bien  $(x, y) \in E$ .

(Formellement,  $\varphi(x, y) = (xy, y)$  est une bijection  $F \rightarrow E$ )

On a donc

$$J_\varphi = (1/v, -u/v^2, 0, 1) \rightarrow 1/v$$

## 9ème cours