
PROGRAMME TRAITÉ EN COURS DE MESURE ET INTÉGRATION

THIERRY FACK

Notes de cours

Les notes de cours de l'an dernier seront suivies à partir du troisième cours. Elles sont disponibles sur le wiki site de la licence de mathématiques :

<http://licence-math.univ-lyon1/doku.php?id=enseignements:automne10mi>

Toutes les informations sur le cours de *Mesure et Intégration* du semestre d'automne 2011 seront déposées sur le site :

<http://licence-math.univ-lyon1/doku.php>

Programme traité lors du cours du 12 septembre

1. Primitives et intégrales

Notion de primitive d'une fonction définie sur un intervalle fermé borné. Intégrale simple. Exemples. Extension de la notion de primitive. Primitive des fonctions en escalier et des fonctions réglées.

2. Intégrale des fonctions continues

Primitive et aire du sous-graphe. L'intégrale simple d'une fonction continue est limite des sommes de Cauchy.

3. Intégrale de Riemann

Définition. Propriétés élémentaires de l'intégrale de Riemann (relation de Chasles, linéarité, positivité de l'intégrale). Une fonction Riemann intégrable est bornée. Majoration de l'intégrale de Riemann au moyen de la norme uniforme de la fonction.

Programme traité lors du cours du 19 septembre

Fin de l'intégrale de Riemann

Limites uniformes de fonctions Riemann intégrables. Exemples de fonctions Riemann intégrables : fonctions continues, continues par morceaux, fonctions réglées). Sommes de Darboux, théorème de Darboux, critère d'intégrabilité de Riemann. Exemples d'application : les fonctions monotones sur un intervalle compact sont Riemann intégrables, le produit de deux fonctions Riemann intégrables est Riemann intégrable.

Ensemble de mesure nulle. Critère de Lebesgue pour l'intégrabilité au sens de Riemann. Exemple de fonction non Riemann intégrable, mais dont l'intégrale peut quand même être définie.

Programme traité lors du cours du 26 septembre

Espaces mesurables

La méthode d'intégration de Lebesgue. Intégration de la fonction de Dirichlet. Tribu sur un ensemble, espace mesurable, exemples. Tribu engendrée par une partie. Tribu engendrée par les points d'un ensemble. Tribu Borélienne. L'image réciproque d'un Borélien par une application continue est un Borélien.

Programme traité lors du cours du 3 octobre

1. Fin des espaces mesurables

Notion de clan (ou algèbre). Classes monotones. Si un clan est contenu dans une classe monotone, alors la tribu engendrée par ce clan est contenue dans cette classe monotone.

2. Espaces mesurés

Mesure positive. Espaces mesurés, espaces σ -finis. Exemples de mesures positives. Propriétés générales des mesures positives.

Programme traité lors du cours du 10 octobre

1. Suite des espaces mesurés

Sous-additivité dénombrable d'une mesure. Événements indépendants. Théorème de Borel-Cantelli sur la loi du zéro-un. Interprétation probabiliste.

2. Construction du prolongement de Lebesgue d'une mesure

Demi-anneau. Mesure positive σ -finie sur un demi-anneau. Exemples de demi-anneaux avec mesure positive σ -finie : l'anneau des intervalles semi-ouverts sur la droite numérique, avec la mesure de Lebesgue. Anneau des pavés semi-ouverts et mesure de Lebesgue n-dimensionnelle. Anneau des cylindres sur $C([a, b], \mathbb{R})$ et mesure de Wiener sur les trajectoires du mouvement Brownien. Énoncé du théorème de prolongement de Lebesgue pour une mesure positive σ -finie sur un demi-anneau. Schéma de la démonstration (incluant la définition de la mesure extérieure et la notion de partie mesurable au sens de Lebesgue).

Programme traité lors du cours du 17 octobre

Prolongement de Lebesgue

Démonstration de l'existence du prolongement de Lebesgue d'une mesure positive sur un demi-anneau σ -fini : mesure extérieure, ensembles négligeables, ensembles mesurables au sens de Lebesgue, la mesure extérieure est une mesure positive sur la tribu des ensembles mesurables au sens de Lebesgue.

Unicité du prolongement de la mesure à la tribu engendrée par le demi-anneau.