

# Integral de Lebesgue

## Problemas para examen

Casi en todos los problemas de esta lista se supone que  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  es un espacio de medida.

Primero definimos la integral para funciones simples medibles positivas, luego para funciones medibles positivas, luego para funciones medibles reales (pidiendo que la integral del valor absoluto sea finita) y para funciones medibles complejas (pidiendo que la integral del valor absoluto sea finita).

### Integración de funciones simples medibles positivas

**1. La representación canónica de una función simple positiva (repaso).** Sea  $X$  un conjunto y sea  $f: X \rightarrow [0, +\infty)$  una función *simple*. Lo último significa que el conjunto de los valores de  $f$  es finito. Numeramos los valores de  $f$  en el orden estrictamente creciente:

$$\text{im}(f) = \{v_1, \dots, v_n\}, \quad 0 \leq v_1 < v_2 < \dots < v_n < +\infty,$$

y para cada  $j$  definimos el conjunto  $B_j$  como la preimagen de  $\{v_j\}$  bajo  $f$ :

$$B_j = f^{-1}[\{v_j\}].$$

Entonces los conjuntos  $B_1, \dots, B_n$  son no vacíos y disjuntos a pares,  $\bigcup_{j=1}^n B_j = X$ , y

$$f = \sum_{j=1}^n v_j \chi_{B_j}.$$

**2.** Recuerde la definición de la integral de Lebesgue de una función simple medible positiva dada por su representación canónica.

**3. La integral de una función simple medible positiva dada por una representación no canónica.** Sea  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  un espacio de medida, sean  $A_1, \dots, A_m \in \mathcal{F}$  conjuntos disjuntos tales que  $X = \bigcup_{k=1}^m A_k$  y sean  $w_1, \dots, w_m \in [0, +\infty]$ . Algunos de los números  $w_1, \dots, w_m$  pueden coincidir, y algunos de los conjuntos  $A_1, \dots, A_m$  pueden ser vacíos. Consideremos la función  $f: X \rightarrow [0, +\infty]$ ,

$$f := \sum_{k=1}^m w_k \chi_{A_k}.$$

Construya la representación canónica de  $f$  y demuestre que para todo  $Y$  en  $\mathcal{F}$

$$\int_Y f \, d\mu = \sum_{k=1}^m w_k \mu(A_k \cap Y).$$

**4. La integral considerada como una función del conjunto de integración es una medida.** Sea  $f: X \rightarrow [0, +\infty)$  una función simple  $\mathcal{F}$ -medible positiva. Se considera la función  $\varphi: \mathcal{F} \rightarrow [0, +\infty]$  definida mediante la fórmula

$$\varphi(Y) := \int_Y f \, d\mu \quad (Y \in \mathcal{F}).$$

Basándose solamente en la definición de la integral para funciones simples medibles positivas demuestre que  $\varphi$  es una medida.

**5. La integral de una función simple que toma sólo un valor en el conjunto de integración.** Sea  $f: X \rightarrow [0, +\infty)$  una función simple  $\mathcal{F}$ -medible positiva y sea  $Y \in \mathcal{F}$  un conjunto tal que  $f$  toma sólo un valor  $w \in [0, +\infty)$  en todos los puntos de  $Y$ :

$$\forall x \in Y \quad f(x) = w.$$

Basándose sólo en la definición de la integral para funciones simples medibles positivas demuestre que

$$\int_Y f \, d\mu = w \mu(Y).$$

**6. Ejemplo, cuando la integral de una función simple medible positiva es cero, aunque el conjunto de integración tiene medida no nula y la función es no nula en algunos puntos del conjunto de integración.** Dé un ejemplo de un espacio de medida  $(X, \mathcal{F}, \mu)$ , una función medible positiva simple  $f \in \mathcal{SM}(X, \mathcal{F}, [0, +\infty))$  y un conjunto medible  $Y \in \mathcal{F}$  tales que

$$\int_Y f \, d\mu = 0 \quad \wedge \quad \mu(Y) > 0 \quad \wedge \quad (\exists x \in Y \quad f(x) > 0).$$

## Integración de funciones medibles positivas

**7.** Escriba la definición de la integral de Lebesgue de una función medible positiva.

**8.** Enuncie y demuestre propiedades elementales de funciones medibles positivas.

**9.** Sean  $f \in \mathcal{M}(X, \mathcal{F}, [0, +\infty])$ ,  $Y \in \mathcal{F}$  tales que

$$\int_Y f \, d\mu < +\infty.$$

Demuestre que

$$\mu(\{x \in Y: f(x) = +\infty\}) = 0.$$

**10. ¿Cuándo la integral de una función medible positiva es nula?** Sea  $f \in \mathcal{M}(X, \mu, [0, +\infty))$  una función tal que

$$\int_X f \, d\mu = 0.$$

Demuestre que  $f \stackrel{\mu\text{-c.t.p.}}{=} 0$ .

**11. Criterio de que la integral de una función medible positiva sobre un conjunto medible es igual a cero.** Sea  $f \in \mathcal{M}(X, \mathcal{F}, [0, +\infty))$  y sea  $Y \in \mathcal{F}$ . Encuentre una condición necesaria y suficiente para que

$$\int_Y f \, d\mu = 0.$$

**12. Desigualdad de Márkov–Chebyshev.** Sean  $f \in \mathcal{M}(X, \mathcal{F}, [0, +\infty))$ ,  $v > 0$ . Demuestre que

$$\mu(\{x \in X : f(x) \geq v\}) \leq \frac{1}{v} \int_X f \, d\mu.$$

**13. Desigualdad de Márkov–Chebyshev para una composición de funciones positivas.** Sean  $f \in \mathcal{M}(X, \mathcal{F}, [0, +\infty))$ ,  $Y \in \mathcal{F}$ ,  $g: [0, +\infty) \rightarrow [0, +\infty)$  una función creciente,  $v \geq 0$ . Demuestre que

$$\mu(\{x \in X : f(x) \geq v\}) \leq \frac{1}{g(v)} \int_X g \circ f \, d\mu.$$

## Convergencia de integrales de funciones medibles positivas

**14. Ejemplos cuando no tiene caso la convergencia de las integrales.** Dé un ejemplo de un espacio de medida finita  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  y una sucesión de funciones  $\mathcal{F}$ -medibles  $f_n: X \rightarrow [0, +\infty)$  tales que  $f_n$  converge puntualmente a una función  $g: X \rightarrow [0, +\infty)$ , pero

$$\int_X f_n \, d\mu \not\rightarrow \int_X g \, d\mu.$$

Se recomienda construir varios ejemplos cuando la sucesión de las integrales  $\int_X f_n \, d\mu$  no tiene límite y otros ejemplos cuando esta sucesión tiene límite, pero el límite no coincide con la integral  $\int_X g \, d\mu$ .

**15. Una parte de la demostración del teorema de la convergencia monótona.**

Sea  $(f_n)_{n \in \mathbb{N}}$  una sucesión creciente de funciones  $\mathcal{F}$ -medibles,  $f_n: X \rightarrow [0, +\infty)$ , y sea  $s: X \rightarrow [0, +\infty)$  una función simple  $\mathcal{F}$ -medible positiva tal que

$$\forall x \in X \quad \lim_{n \rightarrow \infty} f_n(x) \geq s(x).$$

Demuestre que para todo  $c \in (0, 1)$

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_X f_n \, d\mu \geq c \int_X s \, d\mu.$$

**16. Teorema de la convergencia monótona (creciente).** Enuncie el teorema y escriba y complete su demostración basándose en el resultado del problema anterior.

**17. Teorema de la convergencia decreciente.** Enuncie y demuestre el teorema de la convergencia decreciente.

**18.** Demuestre con un ejemplo que en el teorema de la convergencia decreciente la condición “ $f_1 \in L_1(\mu)$ ” no se puede omitir. En otras palabras, construya una sucesión de funciones  $(f_n)_{n \in \mathbb{N}}$  que decrece en cada punto y

$$\int_X \lim_{n \rightarrow \infty} f_n \, d\mu \neq \lim_{n \rightarrow \infty} \int_X f_n \, d\mu.$$

**19. Propiedad aditiva de la integral en el caso de funciones positivas.** Sean  $f, g: X \rightarrow [0, +\infty]$  funciones  $\mathcal{F}$ -medibles positivas. Demuestre que

$$\int_X (f + g) \, d\mu = \int_X f \, d\mu + \int_X g \, d\mu.$$

**20. Propiedad  $\sigma$ -aditiva de la integral en el caso de funciones positivas.** Sean  $f_n: X \rightarrow [0, +\infty]$  funciones  $\mathcal{F}$ -medibles positivas. Denotemos por  $g$  la suma de la serie  $\sum_{n=1}^{\infty} f_n$ :

$$g(x) := \sum_{n=1}^{\infty} f_n(x) \quad (x \in X).$$

Demuestre que

$$\int_X g \, d\mu = \sum_{n=1}^{\infty} \int_X f_n \, d\mu.$$

**21.** Sea  $(Y_n)_{n=1}^{\infty}$  una sucesión en  $\mathcal{F}$  tal que  $(Y_n)_{n=1}^{\infty}$  es creciente y  $\bigcup_{n=1}^{\infty} Y_n = X$ , y sea  $f \in \mathcal{M}(X, \mathcal{F}, [0, +\infty])$ . Demuestre que

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_{Y_n} f \, d\mu = \int_X f \, d\mu.$$

**22. Serie numérica como una integral de Lebesgue.** Sea  $(a_n)_{n \in \mathbb{N}}$  una sucesión en  $[0, +\infty]$ , es decir,  $a: \mathbb{N} \rightarrow [0, +\infty]$ . Consideremos  $\mathbb{N}$  como un espacio de medida:  $(\mathbb{N}, \mathcal{F}, \nu)$ , donde  $\mathcal{F} = 2^{\mathbb{N}}$  y  $\nu$  es la medida de conteo:

$$\nu(A) := \begin{cases} |A|, & \text{si } A \text{ es finito;} \\ +\infty, & \text{si } A \text{ es infinito.} \end{cases}$$

Recordamos que la suma de la serie se define como el límite de las sumas parciales:

$$\sum_{n \in \mathbb{N}} a_n := \lim_{k \rightarrow \infty} \sum_{\substack{n \in \mathbb{N} \\ n \leq k}} a_n.$$

Demuestre que

$$\sum_{n \in \mathbb{N}} a_n = \int_{\mathbb{N}} a \, d\nu.$$

**23. Intercambio de sumas de números positivos.** Sean  $a_{j,k} \in [0, +\infty]$  para todos  $j, k \in \mathbb{N}$ . Demuestre que

$$\sum_{j \in \mathbb{N}} \sum_{k \in \mathbb{N}} a_{j,k} = \sum_{k \in \mathbb{N}} \sum_{j \in \mathbb{N}} a_{j,k}.$$

## Medida generada por una función medible positiva

**24. Medida generada por una función medible positiva.** Sea  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  un espacio de medida y sea  $f \in \mathcal{M}(X, \mathcal{F}, [0, +\infty])$ . Demuestre que la función  $\varphi: \mathcal{F} \rightarrow [0, +\infty]$ , definida mediante la siguiente fórmula, es una medida:

$$\varphi(Y) := \int_Y f \, d\mu \quad (Y \in \mathcal{F}).$$

**25.** Sean  $X, \mathcal{F}, \mu, f, \varphi$  los mismos que en el ejercicio anterior. Demuestre que para toda  $g$  en  $\mathcal{M}(X, \mathcal{F}, [0, +\infty])$ ,

$$\int_X g \, d\varphi = \int_X fg \, d\mu.$$

**26.** Sea  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  un espacio de medida y sea  $f \in \mathcal{M}(X, \mathcal{F}, [0, +\infty])$  una función cuyo conjunto de valores es numerable:

$$\mathcal{R}(f) = \{v_k\}_{k \in \mathbb{N}}.$$

Para todo  $k$  en  $\mathbb{N}$  denotemos por  $A_k$  a la preimagen del conjunto  $\{v_k\}$  bajo la función  $f$ :

$$A_k := f^{-1}[\{v_k\}].$$

Demuestre que

$$\int_X f \, d\mu = \sum_{k \in \mathbb{N}} v_k \mu(A_k).$$

**27.** Demuestre que

$$\int_0^1 \frac{1 + \lfloor \frac{1}{x} \rfloor}{\lfloor \frac{1}{x} \rfloor} \, dx = \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^2}.$$

## Integral de Lebesgue de funciones reales y complejas

28. Sea  $f \in \mathcal{M}(X, \mathcal{F}, \mathbb{R})$ . Muestre que

$$\int_X |f| d\mu < +\infty \iff \int_X f_+ d\mu < +\infty \wedge \int_X f_- d\mu < +\infty.$$

29. Recuerde la definición del conjunto  $L^1(X, \mathcal{F}, \mu, \mathbb{R})$ . Sean  $f \in L^1(X, \mathcal{F}, \mu, \mathbb{R})$ ,  $Y \in \mathcal{F}$ . Recuerde la definición de  $\int_Y f d\mu$ .

30. **La parte positiva de la suma no necesariamente coincide con la suma de las partes positivas.** Dé un ejemplo de funciones  $f, g: X \rightarrow \mathbb{R}$  tales que  $(f + g)_+ \neq f_+ + g_+$ .

31. **La integral de la suma de funciones reales.** Sean  $f, g \in L^1(X, \mathcal{F}, \mu, \mathbb{R})$ . Demuestre que

$$\int_X (f + g) d\mu = \int_X f d\mu + \int_X g d\mu.$$

Puede usar propiedades de la integral de Lebesgue de funciones positivas.

32. **La integral del producto de un número negativo por una función real.** Sea  $f \in L^1(\mu)$  una función integrable con valores reales y sea  $\alpha < 0$ . Demuestre que

$$\int_X (\alpha f) d\mu = \alpha \int_X f d\mu.$$

Puede usar propiedades de la integral de Lebesgue de funciones positivas.

33. **Integral del producto de un número complejo por una función compleja.** Sea  $f \in L^1(X, \mu, \mathbb{C})$  y sea  $\alpha \in \mathbb{C}$ . Demuestre que

$$\int_X (\alpha f) d\mu = \alpha \int_X f d\mu.$$

34. **Transformación de un número complejo en un número positivo por medio de una rotación.** Este ejercicio sirve como un lema para el siguiente teorema. Sea  $z \in \mathbb{C}$ . Construya un número  $\alpha \in \mathbb{C}$  tal que  $|\alpha| = 1$  y  $\alpha z \geq 0$ .

35. **Teorema: Integral y valor absoluto.** Sea  $f \in L^1(X, \mu, \mathbb{C})$ . Demuestre que

$$\left| \int_X f d\mu \right| \leq \int_X |f| d\mu.$$

## Teorema de convergencia dominada

**36. Teorema de convergencia dominada.** Enuncie y demuestre el teorema de la convergencia dominada (de Lebesgue).

**37. Teorema de convergencia uniforme.** Sea  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  un espacio de medida finita ( $\mu(X) < +\infty$ ) y sea  $(f_n)_{n \in \mathbb{N}}$  una sucesión de funciones tales que:

i)  $f_n \in \mathcal{M}(X, \mathcal{F}, \mathbb{C})$  para todo  $n \in \mathbb{N}$ ;

ii)  $f_n \xrightarrow{X} g$ ;

iii)  $g \in L^1(\mu)$ .

Demuestre que

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_X f_n d\mu = \int_X g d\mu.$$

**38.** En el conjunto  $\mathbb{R}$  con la medida de Lebesgue se considera la sucesión de funciones  $f_n: \mathbb{R} \rightarrow [0, +\infty)$  definida mediante la regla  $f_n = \chi_{[n, n+1)}$ , esto es,

$$f_n(x) = \begin{cases} 1, & n \leq x < n+1; \\ 0, & x < n \vee x \geq n+1. \end{cases}$$

Demuestre que  $f_n$  converge a la función  $g = 0$  pero

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int f_n d\mu = 1.$$

Explique por qué no se puede aplicar el teorema de la convergencia dominada. Para ello, calcule la función

$$h(x) = \sup_{n \in \mathbb{N}} |f_n(x)|.$$

**39.** En el intervalo  $(0, 1]$  con la medida de Lebesgue se considera la sucesión de funciones  $f_n: (0, 1] \rightarrow [0, +\infty)$  definida mediante la regla  $f_n = n\chi_{(0, 1/n]}$ , esto es,

$$f_n(x) = \begin{cases} n, & 0 < x \leq \frac{1}{n}; \\ 0, & \frac{1}{n} < x \leq 1. \end{cases}$$

Demuestre que  $f_n$  converge a la función  $g = 0$  pero

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int f_n d\mu = 1.$$

Explique por qué no se puede aplicar el teorema de convergencia dominada. Para ello, calcule la función

$$h(x) = \sup_{n \in \mathbb{N}} |f_n(x)|.$$



**40. Criterio de la convergencia en medida (en el caso de medida finita).** Sean  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  un espacio de medida finita,  $(f_n)_{n \in \mathbb{N}}$  una sucesión en  $\mathcal{M}(X, \mathcal{F}, \mathbb{C})$  y  $g \in \mathcal{M}(X, \mathcal{F}, \mathbb{C})$ . Demuestre que las siguientes condiciones son equivalentes:

(a)  $f_n \xrightarrow{\mu} g$ ;

(b)  $\lim_{n \rightarrow \infty} \int_X \frac{|f_n - g|}{|f_n - g| + 1} d\mu = 0$ .

**41.** Sea  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  un espacio de medida infinita. Definimos las funciones  $f_n, g \in \mathcal{M}(X, \mathcal{F}, \mathbb{C})$  de la siguiente manera:

$$f_n = \frac{1}{n}, \quad g = 0.$$

Demuestre que en este ejemplo  $f_n \xrightarrow{\mu} g$ , pero  $\int_X \frac{|f_n - g|}{|f_n - g| + 1} d\mu \not\rightarrow 0$ .

## Continuidad de la integral con respecto al conjunto de integración

**42. Lema.** Sea  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  un espacio de medida y sea  $f \in L^1(X, \mu, \overline{\mathbb{R}}_+)$ . Definamos los conjuntos  $U_n$  ( $n \in \{0, 1, 2, \dots\}$ ):

$$U_n := \{x \in X : f(x) \geq n\}.$$

Demuestre que

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \mu(U_n) = 0.$$

**43. Lema.** Sea  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  un espacio de medida y sea  $f \in L^1(X, \mu, \overline{\mathbb{R}}_+)$ . Definamos los conjuntos  $U_n$  ( $n \in \{0, 1, 2, \dots\}$ ):

$$U_n := \{x \in X : f(x) \geq n\}.$$

Demuestre que

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_{U_n} f d\mu = 0.$$

**44. Teorema.** Sea  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  un espacio de medida y sea  $f \in L^1(X, \mu, \overline{\mathbb{R}}_+)$ . Demuestre que para todo  $\varepsilon > 0$  existe un  $\delta > 0$  tal que si  $E \in \mathcal{F}$  y  $\mu(E) < \delta$ , entonces  $\int_E f d\mu < \varepsilon$ .

## Integrales impropias

45. Sea  $\mu$  la medida de Lebesgue en  $\mathbb{R}$ , sea  $a \in \mathbb{R}$  y sea  $f \in L^1([a, +\infty), \mu, \mathbb{C})$ . Demuestre que para toda sucesión  $(b_n)_{n \in \mathbb{N}} \subset \mathbb{R}$  que tiende a  $+\infty$ ,

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_{[a, b_n]} f d\mu = \int_{[a, +\infty)} f d\mu.$$

46. Sea  $\mu$  la medida de Lebesgue en  $\mathbb{R}$ , sea  $a \in \mathbb{R}$  y sea  $f \in L^1([a, +\infty), \mu, \mathbb{C})$ . Demuestre que

$$\lim_{b \rightarrow +\infty} \int_{[a, b]} f d\mu = \int_{[a, +\infty)} f d\mu.$$

Sugerencia: utilice el resultado del problema anterior y el criterio del límite en términos de sucesiones (criterio de Heine).

47. Consideremos la función  $f: [1, +\infty) \rightarrow \mathbb{R}$  definida mediante la siguiente fórmula:

$$f(x) = \frac{\text{sen}(x)}{x}.$$

Demuestre que

$$\int_1^{+\infty} |f(x)| dx = +\infty,$$

pero existe y es finito el límite

$$\lim_{b \rightarrow +\infty} \int_1^b f(x) dx.$$

## Integración y conjuntos de medida cero

En los siguientes problemas se supone que  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  es un conjunto de medida. La medida puede ser finita o infinita.

**48. Igualdad casi en todas partes es una relación de equivalencia.** Consideremos el conjunto de funciones complejas  $\mathcal{F}$ -medibles con la relación binaria  $\overset{\mu}{\sim}$  definida mediante la siguiente regla:

$$f \overset{\mu}{\sim} g \iff \mu(\{x \in X : f(x) \neq g(x)\}) = 0.$$

**49. Sucesión de conjuntos cuyas medidas forman una serie convergente.** Sea  $(E_n)_{n \in \mathbb{N}}$  una sucesión de conjuntos  $\mathcal{F}$ -medibles tal que

$$\sum_{n=1}^{\infty} \mu(E_n) < +\infty,$$

y sea

$$A = \{x \in X : \{n \in \mathbb{N} : x \in E_n\} \text{ es infinito}\}.$$

Demuestre que  $\mu(A) = 0$ .

**50. La integral de una función real no nula puede ser cero.** Encuentre un espacio de medida  $(X, \mathcal{F}, \mu)$  y una función  $f \in L^1(X, \mathcal{F}, \mu, \mathbb{R})$  tal que

$$\mu(\{x \in X : f(x) \neq 0\}) > 0, \quad \int_X f \, d\mu = 0.$$

**51. Función real tal que su integral son cero para cualquier conjunto de integración.** Sea  $f \in L^1(X, \mathcal{F}, \mu, \mathbb{R})$  tal que para cada  $A$  en  $\mathcal{F}$

$$\int_A f \, d\mu = 0.$$

Demuestre que  $f$  es cero  $\mu$ -c.t.p.