

Feuille d'exercices III.

Espaces mesurés

Exercice 1. (Mesure de Dirac) Soit (Ω, \mathcal{T}) un espace mesurable quelconque et soit $x \in \Omega$. Pour tout $A \in \mathcal{T}$ on pose

$$\delta_x(A) = \begin{cases} 1 & \text{si } x \in A \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

Montrer que δ_x est une mesure de probabilité. (Indication : Pour montrer la σ -additivité, il suffit de noter que dans une union disjointe $x \in A_n$ pour un seul n , donc si $A = \bigsqcup_n A_n$, $\delta_x(A) = \delta_x(A_n) = \sum_k \delta_x(A_k)$.)

Exercice 2. (Mesure de comptage) Pour chaque $A \in \mathcal{P}(\Omega)$, on pose

$$\nu(A) = \begin{cases} \text{Card}(A) & \text{si } A \text{ fini} \\ +\infty & \text{sinon} \end{cases}$$

Montrer que ν est une mesure. (Indication : Pour montrer la σ -additivité, il suffit de observer que si les A_n sont disjoints alors $\text{Card}(\bigsqcup_n A_n) = \sum_n \text{Card}(A_n)$. Notons que si Ω est dénombrable alors $\nu = \sum_{x \in \Omega} \delta_x$.)

Exercice 3. (Mesure sur la tribu induite) Soit $(\Omega, \mathcal{T}, \mu)$ un espace mesuré et $A \in \mathcal{T}$. Alors $\mu_A(B) \stackrel{\text{def}}{=} \mu(A \cap B)$ est une mesure sur (Ω, \mathcal{T}) . On peut remplacer la tribu \mathcal{T} par la tribu induite $\mathcal{T}_A \stackrel{\text{def}}{=} \{A \cap B : B \in \mathcal{T}\}$. Montrer que $(\Omega, \mathcal{T}, \mu_A)$ et $(A, \mathcal{T}_A, \mu_A)$ sont des espaces mesurés.

Exercice 4. Si $(\Omega, \mathcal{T}, \mu)$ est un espace mesuré et $\lambda \in \mathbb{R}^+$ alors $(\lambda\mu)(A) \stackrel{\text{def}}{=} \lambda\mu(A)$, $A \in \mathcal{T}$, définit une mesure sur \mathcal{T} . En particulier, si $0 < \mu(A) < \infty$ alors $\mu_A(\cdot)/\mu(A)$ est une probabilité (appelée la *probabilité conditionnelle sachant A*).

Exercice 5. Soit $(\Omega, \mathcal{T}, \mu)$ un espace mesuré. Prouver ou réfuter les assertions suivantes.

1. Si $A \in \mathcal{T}$ alors $\mu(\Omega) = \mu(A) + \mu(A^c)$.
2. Si $A, B \in \mathcal{T}$ et $\mu(A \cup B) = \mu(A) + \mu(B)$ alors A et B sont disjoints.
3. Il existe un espace mesuré $(\Omega, \mathcal{T}, \mu)$ tel que $\{\mu(A) : A \in \mathcal{T}\} = \{0, 1, 2\}$.
4. Il existe un espace mesuré $(\Omega, \mathcal{T}, \mu)$ tel que $\{\mu(A) : A \in \mathcal{T}\} = \{0, 1, 3\}$.
5. Soient $\mathcal{T} = \mathcal{T}(\mathcal{E})$ et μ_1 et μ_2 des mesures sur \mathcal{T} telles que $\mu_1(A) = \mu_2(A)$ pour tous $A \in \mathcal{E}$. Est-ce que $\mu_1 = \mu_2$?

Exercice 6. On suppose $\mu(\Omega) < \infty$. Soit

$$\mathcal{A} = \{A \in \mathcal{T} : \mu(A) = \mu(\Omega) \text{ ou } \mu(A) = 0\}.$$

Montrer que \mathcal{A} est une tribu.

Exercice 7. Soient $(\Omega, \mathcal{T}, \mu)$ un espace mesuré, $A, B \in \mathcal{T}$ et $(A_i)_{1 \leq i \leq n}$ une suite finie des éléments dans \mathcal{T} . Montrer que

1. si $\mu(A) < \infty$ alors $|\mu(A) - \mu(B)| \leq \mu(A \Delta B)$;
2. si $\mu(A) + \mu(B) > \mu(\Omega)$ alors $A \cap B \neq \emptyset$;
3. si $\bigcup_{i=1}^n A_i = \Omega$ alors il existe un indice j tel que $\mu(A_j) \geq \frac{\mu(\Omega)}{n}$.

Exercice 8. (\star) Supposons que la mesure μ de l'espace mesuré $(\Omega, \mathcal{T}, \mu)$ est σ -finie. Montrer qu'il existe une suite $(A_n) \subset \mathcal{T}$ d.d.d. telle que $\mu(A_n) < \infty$ et $\Omega = \bigcup_n A_n$.

Exercice 9. (\star) Montrer que la mesure de Lebesgue λ_n sur \mathbb{R}^n est invariante par translation, i.e., $\lambda_n(A) = \lambda_n(\vec{a} + A)$ pour tout $\vec{a} \in \mathbb{R}^n$ et pour tout $A \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^n)$.

Exercice 10. (théorème de récurrence de Poincaré) (\star) On suppose $\mu(\Omega) < \infty$. Une application mesurable $f : \Omega \rightarrow \Omega$ préserve la mesure μ si $\mu(X) = \mu(f^{-1}(X)), \forall X \in \mathcal{T}$. On pose $f^1 \stackrel{\text{def}}{=} f$ et $f^{n+1} \stackrel{\text{def}}{=} f^n \circ f, \forall n \geq 1$.

1. Montrer que f^n préserve μ pour tout $n \geq 1$.
2. On fixe un $A \in \mathcal{T}$ et on désigne $F \stackrel{\text{def}}{=} \{x \in A : f^n(x) \notin A, \forall n \geq 1\}$. (F est l'ensemble des points de A qui ne retournent pas à A sous l'action de f .) Montrer que $(f^n)^{-1}(F) \cap F = \emptyset, \forall n \geq 1$.
3. Montrer que $(f^n)^{-1}(F) \cap (f^m)^{-1}(F) = \emptyset$ si $m \neq n$.
4. En déduire que $\mu(F) = 0$, autrement dit, pour μ -presque tout $x \in A$ il existe $n = n(x) \geq 1$ tel que $f^n(x) \in A$.

Exercice 11. (\star) Soit $(\Omega, \mathcal{T}, \mu)$ un espace mesuré tel que $\{x\} \in \mathcal{T}$ pour tous $x \in \Omega$. On note $D = \{x \in \Omega : \mu(\{x\}) > 0\}$. Est-il vrai que D est a.p.d.

1. si μ est finie,
2. si μ est σ -finie,
3. si μ est quelconque?

Exercice 12. Soient $(\Omega, \mathcal{T}, \mu)$ un espace mesuré et $\{x\} \in \mathcal{T}$ pour tous $x \in \Omega$. On dit que μ est *continue* si $\mu(\{x\}) = 0$, pour tout $x \in \Omega$ et on dit que μ est *discrète* s'il existe un ensemble D a.p.d. tel que $\mu(D^c) = 0$.

1. Montrer que l'équivalence des conditions suivantes :
 - (a) μ est continue;
 - (b) si A est une partie a.p.d. de Ω alors $\mu(A) = 0$;
 - (c) toute partie a.p.d. A de Ω est μ -négligeable.
2. Montrer que μ est discrète si et seulement s'il existe une suite (a_n) de points de Ω et une suite $(c_n) \subset [0, \infty]$ telles que $\mu = \sum_n c_n \delta_{a_n}$.
3. Décrire les espaces mesurés avec μ à la fois discrète et continue.
4. (\star) Supposons maintenant que μ est σ -finie. Montrer que μ s'écrit de façon unique $\mu = \mu_c + \mu_d$, où μ_c est une mesure continue et μ_d est une mesure discrète.

Exercice 13. Soit $f : (\Omega, \mathcal{T}) \rightarrow (\mathbb{R}^n, \mathcal{B}(\mathbb{R}^n))$ une fonction mesurable. Rappelons que si μ est une mesure sur l'espace mesurable (Ω, \mathcal{T}) alors $\mu_f(A) \stackrel{\text{def}}{=} \mu(f^{-1}(A)), \forall A \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^n)$, est une mesure sur $\mathcal{B}(\mathbb{R}^n)$ appelée *la mesure image de μ par f* .

1. Soit $\{a\} \in \mathcal{T}$. Déterminer μ_f si $\mu = \delta_a$.
2. On suppose que $\mu(\Omega) = 1$. Soit $n = 1$ et $B \in \mathcal{T}$. Déterminer μ_{1_B} .
3. On suppose que $\mu(\Omega) < +\infty$ et que $f(\Omega)$ est fini. Déterminer μ_f .

Exercice 14. Soit U un ouvert de \mathbb{R} . Montrer que $\lambda(U) = 0$ si et seulement si $U = \emptyset$.

Exercice 15. (★) Prouver ou réfuter les assertions suivantes :

1. Si $A \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$ et $\lambda(A) > 0$ alors il existe un ouvert non-vide $U \subset \mathbb{R}$ tel que $U \subset A$.
Et réciproquement ?
2. Si $A \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$ et $\lambda(A) < \infty$ alors A est bornée.

Exercice 16. Prouver ou réfuter les assertions suivantes :

1. Une partie d'un ensemble négligeable est négligeable.
2. Une union a.p.d. d'ensembles négligeables est négligeable.
3. Une union d'ensembles négligeables est négligeable.

Exercice 17. (★) Soient $(\Omega, \mathcal{T}, \mu)$ un espace mesuré et

$$\overline{\mathcal{T}} = \{A \Delta N : A \in \mathcal{T}, N \mu\text{-négligeable}\}.$$

1. Montrer que $\overline{\mathcal{T}}$ est une tribu. *C'est la tribu μ -complétée de \mathcal{T}* . (Indication : Pour montrer la stabilité par union dénombrable, on pourra d'abord montrer que $B \in \overline{\mathcal{T}}$ si et seulement si il existe $A_1 \subset B \subset A_2$ avec $A_1, A_2 \in \mathcal{T}$ et $\mu(A_2 \setminus A_1) = 0$).
2. Soit $\overline{\mu} : \overline{\mathcal{T}} \rightarrow \overline{\mathbb{R}}, A \Delta N \mapsto \mu(A)$, où $A \in \mathcal{T}$ et N est μ -négligeable. Montrer que $\overline{\mu}$ est une mesure sur $\overline{\mathcal{T}}$. On obtient un espace mesuré $(\Omega, \overline{\mathcal{T}}, \overline{\mu})$ appelé *l'espace mesuré μ -complété de $(\Omega, \mathcal{T}, \mu)$* .