

**Theorem 1 (Dominated convergence of Lebesgue)** *Let  $g$  be an integrable function defined on the measurable set  $E$  and let  $(f_n)_{n \in \mathbb{N}}$  is a sequence of measurable function so that  $|f_n| \leq g$ . If  $f$  is a function so that  $f_n \rightarrow f$  almost everywhere then*

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int f_n = \int f.$$

*Proof:* The function  $g - f_n$  is non-negative and thus from Fatou lemma we have that  $\int (g - f) \leq \liminf \int (g - f_n)$ . Since  $|f| \leq g$  and  $|f_n| \leq g$  the functions  $f$  and  $f_n$  are integrable and we have

$$\int g - \int f \leq \int g - \limsup \int f_n,$$

so

$$\int f \geq \limsup \int f_n.$$

**Θεώρημα 2 (Κυριαρχημένης σύγκλισης του Lebesgue)** *Έστω ότι η  $g$  είναι μια ολοκληρώσιμη συνάρτηση ορισμένη στο μετρήσιμο σύνολο  $E$  και η  $(f_n)_{n \in \mathbb{N}}$  είναι μια ακολουθία μετρήσιμων συναρτήσεων ώστε  $|f_n| \leq g$ . Υποθέτουμε ότι υπάρχει μια συνάρτηση  $f$  ώστε η  $(f_n)_{n \in \mathbb{N}}$  να τείνει στην  $f$  σχεδόν παντού. Τότε*

$$\lim \int f_n = \int f.$$

*Απόδειξη:* Η συνάρτηση  $g - f_n$  είναι μη αρνητική και άρα από το Λήμμα του Fatou ισχύει  $\int (f - g) \leq \liminf \int (g - f_n)$ . Επειδή  $|f| \leq g$  και  $|f_n| \leq g$  οι  $f$  και  $f_n$  είναι ολοκληρώσιμες, έχουμε

$$\int g - \int f \leq \int g - \limsup \int f_n,$$

άρα

$$\int f \geq \limsup \int f_n.$$