



UNIVERSIDAD NACIONAL AUTONOMA
DE MEXICO

21
247

FACULTAD DE CIENCIAS

UNA MANERA DE CONSTRUIR LA INTEGRAL DE
RIEMANN-STIELTJES Y ALGUNAS
APLICACIONES

T E S I S

QUE PARA OBTENER EL TITULO DE MATEMATICO



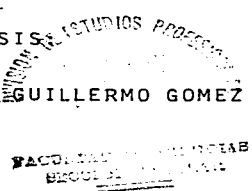
FACULTAD DE CIENCIAS
UNAM

P R E S E N T A :

IBAÑEZ GAXIOLA, JESUS RAMON

DIRECTOR DE TESIS

M. en C. GUILLERMO GOMEZ ALCARAZ



TESIS CON
FALLA DE ORIGEN

MEXICO, D.F.

1997



Universidad Nacional
Autónoma de México



UNAM – Dirección General de Bibliotecas
Tesis Digitales
Restricciones de uso

DERECHOS RESERVADOS ©
PROHIBIDA SU REPRODUCCIÓN TOTAL O PARCIAL

Todo el material contenido en esta tesis esta protegido por la Ley Federal del Derecho de Autor (LFDA) de los Estados Unidos Mexicanos (México).

El uso de imágenes, fragmentos de videos, y demás material que sea objeto de protección de los derechos de autor, será exclusivamente para fines educativos e informativos y deberá citar la fuente donde la obtuvo mencionando el autor o autores. Cualquier uso distinto como el lucro, reproducción, edición o modificación, será perseguido y sancionado por el respectivo titular de los Derechos de Autor.



UNIVERSIDAD NACIONAL
AUTÓNOMA DE
MÉXICO

M. en C. Virginia Abrín Batule
Jefe de la División de Estudios Profesionales de la
Facultad de Ciencias
Presente

Comunicamos a usted que hemos revisado el trabajo de Tesis: "Una manera de Construir
la Integral de Riemann-Stieltjes y Algunas Aplicaciones"

realizado por Jesús Ramón Ibañez Gaxiola

con número de cuenta 7242440-9 , pasante de la carrera de Matemáticas

Dicho trabajo cuenta con nuestro voto aprobatorio.

Atentamente

Director de Tesis	M. en C. GUILLERMO GOMEZ ALCARAZ
Propietario	M. en C. MANUEL FALCONI MAGAÑA
Propietario	DR. JUAN MORALES RODRIGUEZ
Suplente	M. en C. FRANCISCO STRUK CHAVEZ
Suplente	MAT. FERNANDO GARCIA GARCIA

FACULTAD DE CIENCIAS
Consejo Departamental de Matemáticas

DEPARTAMENTO DE MATEMÁTICAS

D E D I C A T O R I A

**A MI HIJO JESUS ABRAHAM
A PESAR DE SU CORTA EXISTENCIA
FUE PARA MI ALGO DE
LO MAS GRANDE**

**A MI MAMA ROSARIO (CHALA)
Y A MI NINA MARIA
QUE LAS RECUERDO CON CARINO
POR SU CONSTANTE APOYO
QUE SIEMPRE ME DIERON**

**A MI ESPOSA CARMEN
Y A MIS HIJOS JESUS Y ABRAHAM
PORQUE FORMAN PARTE DE MI VIDA
Y SON EL ALIENTO EN CADA INSTANTE
PARA SEGUIR ADELANTE CON FIRMEZA**

**A GUADALUPE, EUFEMIA Y CARMEN
COMO MIS MADRES
POR SU CARINO Y ENTREGA
PARA VENCER TODO OBSTACULO**

**A MI PADRE ALFONSO
POR EL APOYO DECIDIDO
QUE SIEMPRE ME BRINDO**

**A MIS HERMANOS
EVERARDO, ANTONIO, ROSARIO Y
JOSE LUIS
POR EL CARINO Y RESPETO
QUE SIEMPRE NOS HEMOS TENIDO**

A G R A D E C I M I E N T O

MIS PADRES, A MI ESPOSA E HIJOS Y A MIS AMIGOS SINCEROS POR SU APOYO EN CADA INSTANTE A LO LARGO DE MI VIDA.

CON MI GRAN RECONOCIMIENTO EN FORMA ESPECIAL A LOS MAESTROS:

FROYLAN VAZQUEZ VAZQUEZ, POR APORTAR LA IDEA DEL TEMA PARA ESTE TRABAJO.

GUILLERMO GOMEZ ALCARAZ, DIRECTOR DE TESIS, POR SU VALIOSA AYUDA Y ORIENTACIONES.

MANUEL FALCONI MAGAÑA, JUAN MORALES RODRIGUEZ, FRANCISCO STRUCK CHAVEZ Y FERNANDO GARCIA GARCIA; POR HABERME BRINDADO LA OPORTUNIDAD DE CONOCER EL MARAVILLOSO MUNDO DE LAS MATEMATICAS Y POR SUS ATINADAS ORIENTACIONES.

A CARMEN ALICIA DELVAL, MI QUERIDA ESPOSA Y PACIENTE MECANOGRafa POR HABER REALIZADO EL TRABAJO CON VERDADERA EFICIENCIA.

ASIMISMO, AGRADEZCO A MIS AMIGOS RIGOBERTO IZAGUIRRE BERRELLEZA, SANTANA FELIX ARMENTA Y FRANCISCO OLOÑO LOPEZ, POR SU VALIOSA AYUDA PARA HACER POSIBLE ESTE TRABAJO. A IMELDA ROJO ARCE POR HABER REALIZADO EFICIENTEMENTE EL MECANOGRafiADO Y DISEÑO, ASI COMO A LAS PERSONAS QUE LABORAN EN EL TALLER DE REPRODUCCION DEL SINDICATO ACADEMICO DE LA UAS.

C O N T E N I D O

0. I N T R O D U C C I O N

1. TEORIAS CLASICAS DE INTEGRACION.
2. INTEGRACION DE STIELTJES.
3. OTRO TRATAMIENTO DE LA INTEGRAL DE RIEMAN-STIELTJES.
4. APLICACIONES.
5. APENDICE SOBRE FUNCIONES CRECIENTES.

O. INTRODUCCION

0.1 UN POCO DE HISTORIA

Durante el siglo XVIII, la integral de una función fue generalmente tratada como la "inversa" de la derivada. Esto es una función $f(x)$ era integrada encontrando una antiderivada o función primitiva $F(X)$ tal que la derivada de $F(X)$ denotada por $F'(X)$ coincide con $f(x)$ i.e. $F'(X)=f(x)$: La integral de $f(x)$ sobre el intervalo $[a,b]$ era entonces dada por el *Teorema Fundamental del Cálculo*, conocido entonces solo de forma heurística [3, pag. 317], y el cual nos dice que

$$\int_a^b f(x)dx=F(b)-F(a)$$

Al mismo tiempo, la idea de integral como cierta clase de límite o como el área de un conjunto de ordenadas bajo una curva era familiar, pero generalmente se utilizaba en la aproximación de integrales en las cuales era imposible o inconveniente encontrar su antiderivada. Ni los límites de sumas ni las áreas de conjuntos planos eran lo suficientemente bien entendidas para proveer las bases de un tratamiento lógico de la integral. En particular, el concepto de área fue completamente intuitivo, aceptado como evidente por sí mismo e innecesaria su definición precisa.

Fue Cauchy quien primero marcó la necesidad de proveer una definición general y probar la existencia de la integral para una considerable clase de funciones que pudieran entonces proporcionar una base para la discusión de integrales particulares y sus propiedades. La definición dada en 1823 por Cauchy empieza con una función $f(x)$ continua (en el sentido actual) sobre el intervalo $[a,b]$ y subdivide éste en n subintervalos por medio de puntos $a = x_0, x_1, \dots, x_n = b$. Con esta subdivisión de $[a,b]$ se asocia la suma aproximada

$$S = \sum_{i=1}^n f(x_{i-1}) \cdot (x_i - x_{i-1}) \quad (1)$$

lo que llevaría a definir la integral $\int_a^b f(x)dx$ como el límite de la suma (1) cuando el máximo de las longitudes $x_i - x_{i-1}$ se aproxima a cero. Esta definición es completada más tarde por Riemann, quien elige un punto arbitrario \bar{x}_i en el i -ésimo subintervalo $[x_{i-1}, x_i]$ para cada $i=1,2,\dots,n$ y define la integral como

$$\int_a^b f(x)dx = \lim_{\delta \rightarrow 0} \sum_{i=1}^n f(\bar{x}_i)(x_i - x_{i-1}) \quad (2)$$

donde δ denota el máximo de las longitudes δ_i de los subintervalos de la partición $[a,b]$. Nótese que ésta es una *Generalización directa* de la definición de Cauchy dada en (1).

La definición de Riemann (2) de la integral fue la más general, no obstante, durante las últimas décadas del siglo XIX esta definición fue reformulada en diversas formas que ayudaron para el desarrollo del concepto de integral y que prepararon el camino para las importantes generalizaciones que se agregaron a principios del siglo XX.

En 1870, varios matemáticos de forma independiente, introdujeron las así llamadas "*Sumas Superior e Inferior de Riemann*" para una función acotada en f sobre $[a,b]$

$$S(p) = \sum_{i=1}^n M_i(x_i - x_{i-1}) \quad \text{y} \quad I(p) = \sum_{i=1}^n m_i(x_i - x_{i-1}) \quad (3)$$

donde p es una partición de $[a,b]$, en n subintervalos y M_i y m_i son los valores máximos y mínimos (hoj sup e inf) de $f(x)$ en el

i-ésimo subintervalo $[x_{i-1}, x_i]$. Hoy estas sumas son llamadas "Sumas de Darboux", las cuales tienen límites S e I cuando $\delta \rightarrow 0$.

En 1880 Vito Volterra introduce el término general "Integral Superior" e "Integral Inferior" para S e I con

$$S = \int_a^{-b} f(x) dx \quad e \quad I = \int_{-a}^b f(x) dx \quad (4)$$

Después, Giuseppe Peano notó que estas integrales dadas en (4), pueden definirse convenientemente como la *mínima cota superior* y como la *máxima cota inferior* de las sumas superior e inferior de Riemann, respectivamente para todas las particiones P del intervalo $[a, b]$

$$\int_a^{-b} f(x) dx = \inf \{ S(P) \} \quad y \quad \int_{-a}^b f(x) dx = \sup \{ I(P) \} \quad (5)$$

La función f es integrable, sí, y solo si las integrales superior e inferior son iguales.

Desde sus orígenes la idea de integral había sido motivada por el concepto de área. En particular si O_f denota el conjunto de ordenadas de una función no-negativa f sobre el intervalo del conjunto de todos los puntos (x, y) con $a \leq x \leq b$ y $0 \leq y \leq b$, la idea era que el valor de la integral $\int_a^b f(x) dx$ debe ser el área $a(O_f)$.

La primera definición formal de área es dada por Peano en 1887. Retomando las ideas de Eudoxo y su método de exhaustión como punto de partida, definió el área interna $a_i(S)$ de S como

la mínima cota superior de las áreas de todos los polígonos que están contenidos en S , y el área exterior $a_e(S)$ como la máxima cota inferior de las áreas de todos los polígonos que contiene a S . Es claro que $a_i(S) \leq a_e(S)$, pero pueden no ser iguales. Por ejemplo si S es el conjunto de todos los puntos (x,y) en el cuadrado unitario $0 \leq x, y \leq 1$ tales que los números x, y son ambos irracionales, entonces $a_e(S) = 1$, el área del cuadrado, pero $a_i(S) = 0$ porque únicamente polígonos degenerados están contenidos en S .

Con la definición de Peano, de área interior y exterior se establece que

$$\int_a^b f(x) dx = a_i(O_f) \quad \text{y} \quad \int_a^{-b} f(x) dx = a_e(O_f) \quad (6)$$

para cualquier función no negativa f sobre $[a,b]$. En caso $a_i(S) = a_e(S)$ el valor común es el área $a(S)$ de S , si f es integrable entonces (6) se reduce a

$$\int_a^b f(x) dx = a(O_f) \quad (7)$$

en este punto, el concepto de la integral viene a cerrar el círculo regresando a su motivación original.

El concepto anterior de área se conoce como "Contenido de Jordan", debido a que Camille Jordan quien le dió el tratamiento definitivo, aunque hay que hacer notar que él usó únicamente cuadrados con lados horizontales y verticales. Jordan define lo que él llamó *Contenido Interior* $c_i(S)$ y *Contenido Exterior* $c_e(S)$ de un conjunto plano, equivalente a las áreas interior y exterior de Peano; Sin embargo, su tratamiento trabaja igualmente bien en todas las dimensiones y

así su concepto de contenido generaliza simultáneamente los conceptos de longitud, área y volumen. El llama al conjunto S Medible con contenido $c(S)$ si $c_1(S) = c_0(S)$.

Jordan procede a definir la integral de Riemann de una función acotada de n variables reales definidas sobre un conjunto medible E en un n -espacio Euclideo. Sea P una partición de E en conjuntos medibles E_1, \dots, E_m con interiores ajenos, y sea P_i un punto arbitrario de E_i $i=1, 2, \dots, m$. Entonces

$$S(P) = \sum_{i=1}^m f(\bar{P}_i) c(E_i)$$

Es una suma de Riemann para f en E , la función f es integrable sobre el conjunto E , con tal de que

$$\int_E f = \lim_{\delta > 0} \sum_{i=1}^m f(\bar{x}_i) c(E_i) \quad (8)$$

exista, siendo el máximo de los diámetros de los conjuntos E_1, \dots, E_m . En el caso unidimensional con $E = [a, b]$, viene a ser

$$\int_a^b f(x) dx = \lim_{\delta > 0} \sum_{i=1}^n f(\bar{x}_i) c(E_i) \quad (9)$$

que en comparación con (2), la partición de $[a, b]$ en subintervalos ha sido generalizada a una partición de $[a, b]$ en conjuntos medibles.

Con estas nociones, se tiene nuevas caracterizaciones de la condición de Integrabilidad de Riemann. Una basada sobre la visión "geométrica" de la integral de una función en términos de el área acotada por la gráfica para f definida y acotada

sobre $[a, b]$, sea E el conjunto de puntos en el plano acotado por la gráfica de la función f , las líneas $x=a$, $x=b$ y el eje x . Entonces f es Riemann-Integrable si, y solo si el conjunto E es Jordan-medible y

$$\int_a^b |f| = c(E), \quad \int_a^b f = c(E^+) - c(E^-) \quad (10)$$

donde E^+ y E^- denota las partes de E por arriba y abajo del eje x respectivamente; [4, introducción x_1]

La introducción del concepto de conjunto medible trajo otra caracterización del criterio de integrabilidad por igualdad de las integrales inferior y superior.

Considérense las sumas más generales

$$I = \sum_{i=1}^n m_i c(E_i) \quad \text{y} \quad S = \sum_{i=1}^n M_i c(E_i)$$

donde E_i son conjuntos medibles, mutuamente ajenos y tales que $[a, b] = \bigcup_{i=1}^n E_i$. Entonces la mínima cota superior de las I y la máxima cota inferior de la S vienen a ser las integrales inferior y superior de f , el criterio de integrabilidad puede establecerse en términos de estas sumas más generales.

Las generalizaciones anteriores permiten ver que una generalización de los conceptos de medida y medibilidad, permiten una generalización de los conceptos de integral e integrabilidad. Supóngase, en otras palabras, que \mathfrak{M} denota una clase de conjuntos medibles, la cual contiene a la clase de conjuntos Jordan-medibles, y supóngase que una medida, $m(E)$ ha sido definido para todos los miembros de \mathfrak{M} en tal forma que $m(E)$ coincida con $c(E)$ cuando E es Jordan-medible. Entonces la

primera caracterización de funciones Riemann-Integrables (10) sugiere que el concepto de integrabilidad puede extenderse a cualquier función acotada f cuyos correspondientes conjuntos E pertenece a \mathfrak{M} . La integral de f puede entonces definirse por

$$\int_a^b f = m(E^+) - m(E^-) \quad (11)$$

de forma semejante la caracterización por igualdad de integrales superior e inferior, sugiere definir integrales superior e inferior $\int_a^b f$ y $\int_{-a}^b f$ con respecto a \mathfrak{M} , como la máxima cota inferior de S^* y la mínima cota superior de I^* para las sumas

$$S^* = \sum_{i=1}^n M_i m(E_i) \quad I^* = \sum_{i=1}^n m_i m(E_i)$$

donde ahora E_i pertenecen a \mathfrak{M} , entonces

$$\int_{-a}^b f \leq \int_a^b f \leq \int_a^{-b} f \leq \int_a^{-b} f$$

y f puede definirse integrable siempre que $\int_{-a}^b f = \int_a^{-b} f$.

Es claro que las definiciones anteriores, basadas sobre el amplio concepto de medibilidad, representan generalizaciones de la integral de Riemann.

Hoy la teoría de la integración de Lebesgue viene a ser (en cierto sentido técnico) la última generalización del concepto de integral de funciones de variable real, la cual a diferencia de considerar sumas de rectángulos como Jordan, se considera conjuntos medibles, que son uniones de una infinidad

numerable de rectángulos. Si en lo anterior \mathfrak{M} denota la clase de conjuntos Lebesgue-medibles, las definiciones llevan a la integral de Lebesgue para funciones acotadas.

Otra significativa generalización de la integral de Riemann fue dada por Thomas-Jean Stieltjes en 1894 por un camino un tanto distinto a los expuestos antes. Stieltjes quien empieza su carrera como astrónomo se da a la tarea de hacer un estudio general de fracciones continuas [3, Pág. 22] en donde usa su nuevo tipo de integrales que más tarde aplica como integrales con respecto a distribuciones de masa total infinita, incluyendo concentraciones puntuales. Introduce la noción de distribución de masa continua, una distribución tal que está completamente determinada cuando $g(x)$, la masa total entre 0 y x es conocida para cada valor positivo de x . La función g es entonces positiva y creciente. Define el momento de orden k , que es definido como el límite de las sumas

$$\sum_{i=1}^n t_i^k [g(x_i) - g(x_{i-1})] \quad (12)$$

cuando $|P| \rightarrow 0$, donde $|P|$ es la norma de la partición de $[a, b]$ con $P = \{a = x_0 < \dots < x_n = b\}$ y $t_i \in [x_{i-1}, x_i]$. Stieltjes mostró que cuando f es continua y g es no necesariamente positiva, el límite correspondiente de (12) existe y le denotó por

$$\int_a^b f(x) dg(x).$$

Integral que posteriormente viene a ser caso particular del trabajo de J. Radón en 1913.

0.2. JUSTIFICACION DE LA TESIS.

A lo largo de la historia, la integral y su definición se han visto reformuladas un gran número de veces, (sección 0.1.) hasta llegar a su sentido más general expuesto en la teoría de Lebesgue. El sentido de la generalización de un concepto matemático, y su importancia, está en las aportaciones de herramienta teórica, en la claridad de sus definiciones y simbología, en las contribuciones pedagógicas que aporte, y en sus aplicaciones a las que permita extenderse.

Es con esta visión que el tratamiento de la Integral de Riemann-Stieltjes propuesto por Ross en [1] se considera de importancia, pues llena con todos los requisitos.

En el sentido teórico presenta varias ventajas sobre la definición clásica. El tratamiento es más general ya que las funciones que son Darboux-Stieltjes en el sentido clásico (capítulo 2) son integrables en este nuevo sentido. Con la definición generalizada se satisfacen algunas propiedades que en la teoría clásica no se verifican, en particular, si las funciones integrando f e integrador F tienen discontinuidades comunes, entonces f no es integrable respecto a F ; este incómodo resultado desaparece en el tratamiento generalizado. Mostraremos (teorema 3.2.4) que toda función f , seccionalmente continua o seccionalmente monótona y acotada siempre es F -integrable.

En la sección 3.2 se define la integral generalizada de Riemann Stieltjes de forma semejante a como es definido la integral de Darboux-Stieltjes en su sentido generalizado (sección 3.1) y se procede a compararlas entre sí y con las definiciones clásicas dadas en los capítulos anteriores. *Si una función es Darboux-Stieltjes en el sentido clásico, entonces es*

Darboux-Stieltjes y Riemann-Stieltjes en el sentido generalizado y las tres integrales coinciden. La fórmula correcta para integrales de Lebesgue-Stieltjes del teorema de integración por partes dada por Hewitt [2] es demostrada sin referencia a la teoría de Lebesgue-Stieltjes.

Respecto a la notación, la integral generalizada solo requiere algunos cambios mínimos, y los teoremas de caracterización y de propiedades de la integral en el sentido generalizado se desarrollan sin alguna dificultad.

Pedagógicamente la teoría presupone conocimientos mínimos de análisis y puede desarrollarse a partir de la definición de integral de Riemann con la visión de encaminarse a la teoría de Lebesgue.

El presente trabajo busca ser autocomprensible en el sentido de no requerir de mayor material extra para su lectura, presenta un breve repaso de las teorías clásicas de integración de Riemann y Riemann-Stieltjes (capítulo 1,2) un desarrollo completo de la teoría de la integral de Riemann-Stieltjes (capítulo 3) en su sentido generalizado así como las comparaciones con las teorías clásicas. La introducción pretende enmarcar históricamente el desarrollo de las distintas generalizaciones de la integral de Riemann.

C A P I T U L O 1
TEORIAS CLASICAS DE INTEGRACION

1.1 INTEGRAL DE DARBOUX.

Definición 1.1.1.- Sea $[a,b]$ un intervalo de \mathbb{R} . Por una partición p de $[a,b]$ entenderemos un subconjunto finito de $[a,b]$, $P = \{ t_0, t_1, \dots, t_n \}$ tal que

$$a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b$$

Definición 1.1.2.- Sea f una función real acotada en un intervalo cerrado $[a,b]$. Para $A \subseteq [a,b]$ adoptamos la notación

$$M(f,A) = \text{SUP} \{ f(x) ; x \in A \} \quad \text{y} \quad m(f,A) = \text{inf} \{ f(x) : x \in A \}$$

La *Suma Superior de Darboux* $S(f,p)$ de f con respecto a la partición p es la suma

$$S(f,p) = \sum_{k=1}^n M(f, [t_{k-1}, t_k]) (t_k - t_{k-1})$$

Y la *Suma Inferior de Darboux* es

$$I(f,p) = \sum_{k=1}^n m(f, [t_{k-1}, t_k]) (t_k - t_{k-1})$$

Es importante notar que

$$S(f,p) \leq \sum_{k=1}^n M(f, [a,b]) (t_k - t_{k-1}) = M(f, [a,b]) (b-a)$$

De la misma forma

$$I(f, p) \cong \sum_{k=1}^n m(f, [a, b]) \cdot (t_k - t_{k-1}) = m(f, [a, b]) (b-a)$$

y así:

$$m(f, [a, b]) (b-a) \leq I(f, p) \leq S(f, p) \leq M(f, [a, b]) \cdot (b-a) \quad (1)$$

Definición 1.1.3.- La *Integral Superior de Darboux* $S(f)$ de f en $[a, b]$ está definida por:

$$S(f) = \inf \{ S(f, p) : p \text{ es partición de } [a, b] \}$$

y la *Integral Inferior de Darboux* es

$$I(f) = \sup \{ I(f, p) : p \text{ es partición de } [a, b] \}.$$

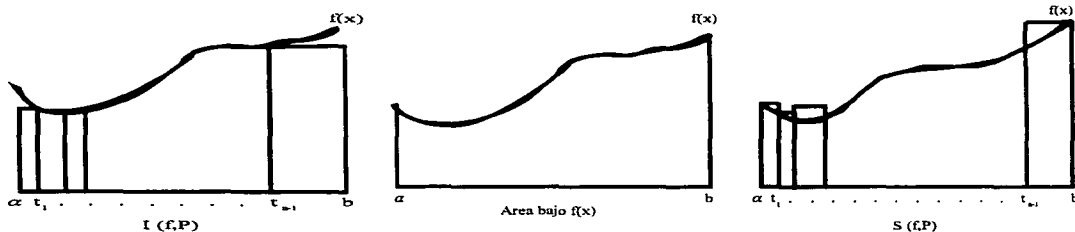
En vista de (1), $S(f)$ y $I(f)$ son números reales. Diremos que f es *Darboux Integrable* en $[a, b]$ si $I(f) = S(f)$; en este caso escribimos

$$(D) \int_a^b f = (D) \int_a^b f(x) dx = I(f) = S(f)$$

para este valor común.

Una interpretación para este concepto de integral es el de considerar a $(D) \int_a^b f$ como el área de la región bajo la

gráfica de f , cuando $f(x) \geq 0$ para todo $x \in [a, b]$, ya que cada suma inferior de Darboux representa el área de una unión de rectángulos que están contenidos en la región. Más aún, $(D) \int_a^b f$ es el único número que es mayor o igual que todas las sumas inferiores de Darboux, y más pequeño o igual que todas las sumas superiores de Darboux (figura 1).



Mostraremos algunos ejemplos que, aunque elementales desde el punto de vista del cálculo integral, en nuestro caso servirán para fijar más los conceptos y terminología antes señaladas.

Ejemplo 1.1.1.- La función más simple, cuya integral no es obvia es $f(x) = x^2$, consideremos a f definido en $[0, b]$, $b > 0$.

Para una partición

$$p = \{0 = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$$

tenemos

$$S(f, p) = \sum_{k=1}^n \sup \left\{ x^2 : x \in [t_{k-1}, t_k] \right\} (t_k - t_{k-1}) = \sum_{k=1}^n t_k^2 (t_k - t_{k-1})$$

elegimos $t_k = \frac{kb}{n}$, y usando el hecho de que

$$\sum_{k=1}^n k^2 = \frac{n(n+1)(2n+1)}{6}$$

Obtenemos

$$\begin{aligned} S(f, p) &= \sum_{k=1}^n \frac{k^2 b^2}{n^2} \left(\frac{b}{n} \right) = \frac{b^3}{n^3} \sum_{k=1}^n k^2 = \frac{b^3}{n^3} \frac{(n(n+1)(2n+1))}{6} \\ &= \frac{b^3}{6} \left(1 + \frac{1}{n}\right) \left(2 + \frac{1}{n}\right). \end{aligned}$$

Para valores grandes de n , $S(f, p)$ se acerca a $b^3/3$, por lo que concluimos que

$$\inf \{ S(f, p) : P \text{ partici3n de } [a, b] \} = S(f) = \frac{b^3}{3}$$

Para la misma partici3n calculamos

$$I(f, p) = \sum_{k=1}^n \frac{(k-1)^2 b^2}{n^2} - \left(\frac{b}{n} \right) = \frac{b^3}{n} \sum_{k=1}^n (k-1)^2 = \frac{b^3}{n} \frac{(n-1)(n)(2n-1)}{6}$$

$$= \frac{b^3}{6} \left(1 - \frac{1}{n}\right) \left(2 - \frac{1}{n}\right),$$

que para valores grandes de n se acerca a $\frac{1}{3}b^3$, por lo que sup

$\{I(f,p): p \text{ es partición de } [a,b]\} = I(f)$

debe cumplir

$$I(f) \approx \frac{b^3}{3}.$$

Nótese que las sumas superiores de Darboux se aproximan al valor $\frac{b^3}{3}$ por valores mayores que este (por exceso), mientras que las sumas inferiores de Darboux lo hacen por valores menores que $\frac{b^3}{3}$ (aproximaciones por defecto).

Como se mostrará en el 1er. teorema $I(f) \approx S(f)$, y podemos concluir que $I(f) = S(f) = \frac{b^3}{3}$, es decir, que $f(x) = x^2$ es Darboux-Integrable en $[0,b]$ y

$$(D) \int_0^b x^2 dx = \frac{1}{3}b^3$$

Ejemplo 1.1.2.- En el intervalo $[0,b]$ consideramos la función $f(x)$ tal que $f(x)=1$ para x racional en $[0,b]$ y $f(x)=0$ para x irracional en $[0,b]$.

Para cualquier partición $p = \{0=t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$

tenemos

$$S(f, p) = \sum_{k=1}^n M(f, [t_{k-1}, t_k]) \cdot (t_k - t_{k-1}) = \sum_{k=1}^n 1 \cdot (t_k - t_{k-1}) = b$$

y

$$I(f, p) = \sum_{k=1}^n m(f, [t_{k-1}, t_k]) \cdot (t_k - t_{k-1}) = \sum_{k=1}^n 0 \cdot (t_k - t_{k-1}) = 0.$$

Se sigue que $S(f) = b$ e $I(f) = 0$. Las integrales superior e inferior de Darboux no coinciden y por lo tanto f no es Darboux-Integrable.

Ejemplo 1.1.3.- Sea $f(x) = x$ para x racional $f(x) = 0$ para x irracional, $x \in [0, b]$.

Para una partición $p = \{0 = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$ tenemos

$$S(f, p) = \sum_{k=1}^n M(f, [t_{k-1}, t_k]) \cdot (t_k - t_{k-1}) = \sum_{k=1}^n t_k (t_k - t_{k-1});$$

y tomando $t_k = \frac{kb}{n}$ tenemos que

$$S(f, p) = \sum_{k=1}^n \frac{kb}{n} \cdot \frac{b}{n} = \frac{b^2}{n^2} \sum_{k=1}^n k = \frac{b^2}{n^2} \cdot \left[\frac{n(n+1)}{2} \right] = \frac{b^2}{2} \left(1 + \frac{1}{n} \right);$$

para valores grandes de n ($n \rightarrow \infty$), $S(f, p) \rightarrow \frac{b^2}{2}$ mientras que

$$I(f, p) = \sum_{k=1}^n m(f, [t_{k-1}, t_k]) \cdot (t_k - t_{k-1}) = \sum_{k=1}^n 0 \cdot (t_k - t_{k-1}) = 0.$$

Concluiremos que $f(x)$ no es Darboux-Integrable en $[0, b]$.

Demostraremos algunas propiedades de la Integral de Darboux que nos permitirán caracterizarla.

Lema 1.1.1.- Sea f una función acotada en $[a, b]$. Si p y Q son particiones de $[a, b]$ y $P \leq Q$ entonces

$$I(f, p) \leq I(f, Q) \leq S(f, Q) \leq S(f, p). \quad (2)$$

Demostración: La desigualdad central se sigue de la definición de sumas inferior y superior de Darboux. Probaremos que

$$I(f, p) \leq I(f, Q)$$

Supóngase que Q tiene únicamente un punto más que p , digamos u .

Si $p = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$ entonces

$Q = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_{k-1} < u < t_k < \dots < t_n = b\}$

para alguna $k \in \{1, 2, \dots, n\}$.

La suma inferior de Darboux para P y Q es la misma excepto para los términos que involucran a t_{k-1} y t_k . En efecto, la diferencia de sumas es

$$I(f, Q) - I(f, p) = m(f, [t_{k-1}, u]) \cdot (u - t_{k-1}) + m(f, [u, t_k]) \cdot (t_k - u) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) \cdot (t_k - t_{k-1}).$$

Basta probar que esta diferencia es positiva. Usando las propiedades del ínfimo de subconjuntos de \mathbb{R} , vemos que

$$m(f, [t_{k-1}, t_k]) \cdot (t_k - t_{k-1}) = m(f, [t_{k-1}, t_k]) \cdot \left\{ (t_k - u) + (u - t_{k-1}) \right\} \\ \leq m(f, [u, t_k]) \cdot (t_k - u) + \\ m(f, [t_{k-1}, u]) \cdot (u - t_{k-1}).$$

En caso de que Q contenga más de un punto que P , la desigualdad se sigue por aplicaciones repetidas del argumento anterior.

Para probar que $S(f, Q) \leq S(f, P)$ se sigue un argumento análogo. //

El siguiente lema nos afirma que sin importar las particiones que se tomen, toda suma inferior de Darboux será menor o igual que toda suma superior de Darboux.

Lema 1.1.2.- Si f es una función acotada, definida en $[a, b]$, y si P, Q , son particiones de $[a, b]$, entonces

$$I(f, P) \leq S(f, Q) \tag{3}$$

Demostración.- El conjunto dado por $P \cup Q$ es a su vez una partición de $[a, b]$. Como $P \subseteq P \cup Q$ y $Q \subseteq P \cup Q$, aplicando el lema 1.1.1. obtenemos

$$I(f, P) \leq I(f, P \cup Q) \leq S(f, P \cup Q) \leq S(f, Q). //$$

El siguiente teorema justifica lo utilizado en los ejemplos referente a que la integral inferior de Darboux es menor o igual que la integral superior de Darboux.

Teorema 1.1.1.- Si f es una función acotada definida en $[a,b]$ entonces

$$I(f) \leq S(f)$$

Demostración.- Tomemos una partición fija P . El lema 1.1.2 nos muestra que $I(f,P)$ es una cota inferior para el conjunto

$$\{S(f,Q): Q \text{ es partición de } [a,b]\}$$

de aquí se deduce que $I(f,P)$ debe ser menor o igual que la máxima cota inferior (\inf) de este conjunto, i.e.

$$I(f,P) \leq S(f)$$

Esta desigualdad nos muestra que $S(f)$ es una cota superior para el conjunto

$$\{I(f,P): P \text{ es partición de } [a,b]\},$$

por lo que $S(f)$ debe ser mayor o igual que la mínima cota superior (\sup) de este conjunto; esto es, se debe tener que

$$I(f) \leq S(f) \quad . \quad //$$

La importancia del teorema siguiente es que nos da un "Criterio de Cauchy" para Integribilidad de funciones en el sentido de Darboux.

Teorema 1.1.2.- Una función acotada f , definida en $[a,b]$ es Darboux-Integrable si, y solo si, para cada $\epsilon > 0$, existe una partición P de $[a,b]$ tal que

$$S(f,P) - I(f,P) < \epsilon \quad (4)$$

Demostración.- Necesidad: Supóngase que f es Darboux-Integrable y considérese una $\epsilon > 0$. Por las propiedades del sup e inf, existen particiones P_1 y P_2 de $[a,b]$, que satisfacen

$$I(f,P_1) > I(f) - \frac{\epsilon}{2} \quad \text{y} \quad S(f,P_2) < S(f) + \frac{\epsilon}{2} .$$

Para $P = P_1 \cup P_2$, y aplicando el lema 1.1.1, obtenemos

$$S(f,P) - I(f,P) \leq S(f,P_2) - I(f,P_1) < S(f) + \frac{\epsilon}{2} - \left[I(f) - \frac{\epsilon}{2} \right] = S(f) - I(f) + \epsilon = \epsilon ,$$

puesto que $S(f) = I(f)$ al ser f Darboux-Integrable. Esto prueba (4).

Suficiencia: Supóngase que para cada $\epsilon > 0$, la desigualdad (4) se cumple para alguna partición P ; entonces

$$S(f) \leq S(f,P) = S(f,P) - I(f,P) + I(f,P) < \epsilon + I(f,P) \leq \epsilon + I(f)$$

puesto que ϵ es arbitrario tenemos que $S(f) \leq I(f)$ y por el teorema 1.1.1. concluimos que $S(f) = I(f)$, i.e., f es Darboux-Integrable. //

Definición 1.1.4.- La norma de una partición P es la máxima longitud de los subintervalos comprendidos en P y se representa por $|P|$. Así, si $P = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_{k-1} < t_k < \dots < t_n = b\}$ definimos $|P| = \max\{t_k - t_{k-1} : k=1, 2, \dots, n\}$.

Con esta definición podemos dar otro criterio para Integrabilidad en sentido de Darboux.

Teorema 1.1.3.- Una función acotada f en $[a,b]$ es Darboux-Integrable sí, y solo si, para cada $\epsilon > 0$, hay un $\delta > 0$ tal que para todas las particiones P de $[a,b]$ con $|P| < \delta$ se tiene que $S(f,P) - I(f,P) < \epsilon$.

Demostración.- Necesidad: Supóngase que f es integrable en $[a,b]$, sea $\epsilon > 0$ y selecciónese una partición $P_0 = \{a = u_0 < u_1 < \dots < u_m = b\}$ de $[a,b]$ tal que

$$S(f, P_0) - I(f, P_0) < \epsilon/2.$$

Puesto que f es acotada, existe $B > 0$ tal que $|f(x)| \leq B$ para toda $x \in [a,b]$. Sea $\delta = \epsilon / (8mB)$, en donde m es el número de intervalos comprendidos en P . Para verificar la condición del teorema, considérese alguna partición $P = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$ con $|P| < \delta$. Sea $Q = P \cup P_0$. Si Q tiene un elemento más que P , una ojeada en la demostración del lema 1.1.1. nos lleva a que

$$I(f, Q) - I(f, P) \leq B(t_k - t_{k-1}) - (-B)(t_k - t_{k-1}) \leq B|P| + B|P| = 2B|P|.$$

Este es el caso en que Q tiene un solo elemento más que P . En general, puesto que Q tiene a lo más m elementos que no están en P , tendremos

$$I(f, Q) - I(f, P) \leq 2m B |P| \leq 2mB\delta = \epsilon/4.$$

Por el lema 1.1.1. tenemos que $I(f, P_0) \leq I(f, Q)$ y así también

$$I(f, P_0) - I(f, P) < \epsilon/4.$$

Similarmente, $S(f,P) - S(f,P_0) < \varepsilon/4$, con lo que

$$S(f,P) - I(f,P) \leq S(f,P_0) - I(f,P_0) + \varepsilon/2 < \varepsilon.$$

Suficiencia: El teorema anterior (1.1.2.) nos muestra que la condición $\varepsilon - \delta$ en este caso implica la integrabilidad de f en el sentido de Darboux. //

1.2. INTEGRAL DE RIEMANN.

Definición 1.2.1.- Sea f una función acotada, definida en $[a,b]$ y sea $P = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$. una *Suma de Riemann* de f asociada con la partición P es una suma de la forma

$$R(f,P) = \sum_{k=1}^n f(x_k)(t_k - t_{k-1})$$

Donde $x_k \in [t_{k-1}, t_k]$ para $k = 1, 2, \dots, n$

Nótese que la elección de los x_k es enteramente arbitraria, así que hay una infinidad de sumas de Riemann asociadas con una misma función y partición.

Definición 1.2.2.- Sea f una función acotada definida en $[a,b]$, f se dice *Riemann-Integrable* en $[a,b]$ si existe un número r , con la siguiente propiedad:

Para cada $\varepsilon > 0$, existe $\delta > 0$ tal que $|R - r| < \varepsilon$ para cada suma de Riemann R de f asociada con una partición P , tal que $|P| < \delta$.

El número r es la *Integral de Riemann* de f en $[a,b]$ y la denotamos

$$(R) \int_a^b f = (R) \int_a^b f(x) dx = r$$

Teorema 1.2.1- Una función acotada f , definida sobre $[a,b]$, es Riemann-Integrable sí, y solo si, es Darboux integrable, en cuyo caso los valores de las integrales coinciden.

Demostración. Supongamos que f es Darboux-Integrable, sobre $[a,b]$ en el sentido de la definición 1.1.3. sean $\epsilon > 0$ y $\delta > 0$ elegidos de tal forma que la condición del teorema 1.1.3. Se cumple.

$$\text{Para cada suma de Riemann } R(f,P) = \sum_{k=1}^n f(x_k)(t_k - t_{k-1})$$

asociada con una partición P , con $|P| < \delta$, tenemos

$$I(f,P) \leq R(f,P) \leq S(f,P)$$

y además

$$S(f,P) < I(f,P) + \epsilon \leq I(f) + \epsilon = (D) \int_a^b f + \epsilon$$

y también

$$I(f,P) > S(f,P) - \epsilon \geq S(f) - \epsilon = (D) \int_a^b f - \epsilon$$

con estas desigualdades tenemos

$$|R(f,P) - (D) \int_a^b f| < \epsilon$$

por lo que f es Riemann-Integrable y

$$(R) \int_a^b f = (D) \int_a^b f$$

Ahora supóngase que f es Riemann-Integrable en el sentido de la definición 1.2.2., considérese $\epsilon > 0$, sean $\delta > 0$ y r como se da en la definición.

Seleccionando alguna partición

$$P = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$$

con $|P| < \delta$, y para cada $k = 1, 2, \dots, n$ selecciónese x_k en $[t_{k-1}, t_k]$ tal que

$$f(x_k) < m(f, [t_{k-1}, t_k]) + \epsilon$$

la suma de Riemann R para esta elección de los x_k satisface

$$R(f, P) \leq I(f, P) + \epsilon(b-a)$$

así como

$$|R(f, P) - r| < \epsilon$$

se sigue que

$$I(f) \geq I(f, P) \geq R(f, P) - \epsilon(b-a) > r - \epsilon - (b-a);$$

puesto que ϵ es arbitrario, concluimos que $I(f) \geq r$. Un argumento similar nos muestra que $S(f) \geq r$ y, puesto que $I(f) \leq S(f)$, vemos que

$$I(f) = S(f) = r,$$

lo que muestra que f es Darboux-Integrable y que

$$(D) \int_a^b f = r = (R) \int_a^b f . //$$

El siguiente teorema nos presenta algunas de las propiedades que cumple la integral de Riemann.

Teorema 1.2.2.- Sean f y g funciones integrables sobre $[a, b]$ y sea c un número real. Entonces

$$i) \int_a^b cf(x)dx = c \int_a^b f(x)dx;$$

$$ii) \int_a^b [f(x)+g(x)] dx = \int_a^b f(x)dx + \int_a^b g(x)dx;$$

$$iii) \int_a^b f(x)dx = \int_a^c f(x)dx + \int_c^b f(x)dx \quad (a < c < b);$$

iv) Si $f(x) \leq g(x)$ en $[a, b]$, entonces

$$\int_a^b f(x)dx \leq \int_a^b g(x)dx.$$

$$v) \left| \int_a^b f(x)dx \right| \leq \int_a^b |f(x)|dx.$$

Omitimos la demostración. //

Un conjunto N es "a lo más numerable" si es finito o infinito numerable.

Definición 1.2.3.- Un conjunto S de números reales tiene *medida cero* si, para cada $\epsilon > 0$, existe una cubierta a lo más numerable $(I_\lambda)_{\lambda \in N}$ de intervalos abiertos, tal que la suma de

sus longitudes es menor que ε , esto es, si $I_\lambda = (a_\lambda, b_\lambda)$ tenemos que

$$\text{ScUI}_{\lambda \in \mathbb{N}} \quad \text{Y} \quad \sum_{\lambda \in \mathbb{N}} (b_\lambda - a_\lambda) < \varepsilon.$$

Teorema 1.2.3.- Sea f una función real, acotada y definida sobre $[a, b]$. Sea D el conjunto de discontinuidades de f en $[a, b]$. f es Riemann-Integrable en $[a, b]$ si, y solo si, D es un conjunto de medida cero.

Demostración. Necesidad.- Definamos para $T \subseteq [a, b]$

$$\Omega_f(T) = \text{Sup} \{f(x) - f(y) : x, y \in T\}$$

$$B(x, h) = \{y \in \mathbb{R}; \quad |y - x| < h\}$$

$$w_f(x) = \lim_{h \rightarrow 0^+} \Omega_f(B(x, h) \cap [a, b])$$

Nótese que si $x \in D$, $w_f(x) > 0$ por lo que se tiene

$$D = \bigcup_{k=1}^{\infty} D_k, \quad D_k = \{x / w_f(x) \geq 1/k\}$$

Si suponemos que D no es de medida cero, algún D_k No es de medida cero y si P es una partición de $[a, b]$

$$\begin{aligned} S(f, P) - I(f, P) &= \sum_{k=1}^n \left[M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) \right] \cdot (t_k - t_{k-1}). \\ &= S_1 + S_2 \geq S_1 \end{aligned}$$

donde en S_1 están los términos correspondientes a subintervalos que contengan en su interior puntos de D . Como D_{k_1} no es de medida cero, hay un $\varepsilon > 0$ tal que toda cubierta a lo más numerable de D_{k_1} , tiene suma de longitudes $\geq \varepsilon$, los subintervalos de S_1 cubren a D_{k_1} y en ellos $M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) \geq \frac{1}{k_1}$

así que $S_1 \geq \frac{\epsilon}{K_1}$

por lo que la condición de integrabilidad no se satisface.

Suficiencia. Supongamos que D tiene medida cero. Como cada D_k tiene medida cero, lo cubrimos con intervalos tales que la suma de sus longitudes sea menor que $1/k$. Como D_k es compacto basta un número finito de intervalos. La unión de estos intervalos es un conjunto abierto A_k , así que $B_k = [a,b] - A_k$ es la unión de un número finito de intervalos cerrados contenidos en $[a,b]$. Sea I uno de ellos. Si $x \in I$, $w_f(x) < \frac{1}{k}$. Hay una subdivisión de I en un número finito de subintervalos T de longitud $< \delta$ en los que $\Omega_f(T) < \frac{1}{k}$. Construimos una partición p_k de $[a,b]$ tal que si p es más fina que p_k

$$S(f,p) - I(f,p) = S_1 + S_2 \quad \text{y} \quad S_2 < \frac{b-a}{k}, \quad S_1 \leq \frac{M-m}{k}$$

donde S_1 contiene los términos correspondientes a subintervalos que contienen en su interior puntos de D_k y donde M y m son el sup e inf de f en $[a,b]$. Como esto vale para toda $k \geq 1$, f satisface la condición de integrabilidad en $[a,b]$. //

CAPITULO 2

INTEGRACION DE STIELTJES

2.1 INTEGRAL DE RIEMANN-STIELTJES

A continuación presentaremos la definición de la Integral de Riemann-Stieltjes, concepto más general que las integrales del capítulo anterior. Esta integral incluye dos funciones f y F en lugar de una sola, y la integral de Riemann se presenta como un caso particular.

Al igual que en las secciones anteriores una partición p de $[a,b]$ es un subconjunto finito ordenado de puntos

$$p = \{a=t_0 < t_1 < \dots < t_n=b\}.$$

La norma de p , $|p|$, es el mayor de los n números $t_k - t_{k-1}$. La partición p' de $[a,b]$ se dice que es más fina que p (o' un refinamiento de p), si $p \leq p'$.

Nótese que si $p \leq p'$, entonces $|p'| \leq |p|$.

Definición 2.1.1.- Sean f y F dos funciones acotadas definidas en $[a,b]$. Sean $P = \{a=t_0 < t_1 < \dots < t_n=b\}$ una partición de $[a,b]$ y x_k un punto del subintervalo $[t_{k-1}, t_k]$ para $k=1,2,\dots,n$. Una suma de la forma

$$R_F(f, p) = \sum_{k=1}^n f(x_k) \cdot [F(t_k) - F(t_{k-1})]$$

se denomina suma de Riemann-Stieltjes de f con respecto de F .

Definición 2.1.2.- Sean f y F dos funciones acotadas y definidas en $[a,b]$. Decimos que f es Riemann-Stieltjes Integrable con respecto a F en $[a,b]$, y escribimos $f \in R(F)$ en $[a,b]$, si existe un número r que tiene la propiedad siguiente:

Para todo $\epsilon > 0$ existe una partición P_ϵ de $[a,b]$ tal que para toda partición p más fina que P_ϵ y para todo x_k en $[t_{k-1}, t_k]$ tenemos

$$|R_f(f,p) - r| < \epsilon.$$

El número r , si existe, es llamado la Integral de Riemann-Stieltjes de f con respecto a F en $[a,b]$ y lo escribimos

$$(R-S) \int_a^b f dF \quad \text{o} \quad (R-S) \int_a^b f(x) dF(x).$$

Las funciones f y F en la Integral son llamadas respectivamente integrando e integrador. Nótese que en el caso de que $F(x) = x$ tenemos el caso particular de la Integral de Riemann (sección 1.2).

Presentaremos solo algunos teoremas importantes de ésta teoría.

Teorema 2.1.1.- (Propiedades Lineales de la Integral)

(a) Si $f \in R(F)$ y $g \in R(F)$ en $[a,b]$, entonces $g + f \in R(F)$, $cf \in R(F)$ para toda constante c , y

$$(R-S) \int_a^b (f+g) dF = (R-S) \int_a^b f dF + (R-S) \int_a^b g dF$$

$$(R-S) \int_a^b c f dF = c \cdot (R-S) \int_a^b f dF$$

(b) Si $f \in R(F_1)$ en $[a, b]$ y $f \in R(F_2)$ en $[a, b]$ entonces $f \in R(c_1 F_1 + c_2 F_2)$ en $[a, b]$ (para cualesquiera constante c_1 y c_2) y tenemos

$$(R-S) \int_a^b f d(c_1 F_1 + c_2 F_2) = c_1 (R-S) \int_a^b f dF_1 + c_2 (R-S) \int_a^b f dF_2.$$

Omitimos su demostración. //

Teorema 2.1.2.- (Integración por partes). Si $f \in R(F)$ en $[a, b]$ entonces $F \in R(f)$ en $[a, b]$ y tenemos

$$(R-S) \int_a^b f(x) dF(x) + (R-S) \int_a^b F(x) df(x) = f(b)F(b) - f(a)F(a).$$

Demostración. Tomemos un $\epsilon > 0$, tenemos que $(R-S) \int_a^b f dF$ existe, por lo que hay una partición P de $[a, b]$ tal que para toda P' más fina que p_ϵ se cumple

$$|R_F(f, P') - (R-S) \int_a^b f dF| < \epsilon$$

tomemos cualquier suma de Riemann-Stieltjes para la integral

$$(R-S) \int_a^b F df, \text{ sea esta}$$

$$R_F(f, P) = \sum_{k=1}^n F(x_k) (f(t_k) - f(t_{k-1}))$$

$$= \sum_{k=1}^n F(x_k) f(t_k) - \sum_{k=1}^n F(x_{k-1}) f(t_{k-1})$$

donde P es más fina que P_C . Tomemos $A=f(b)F(b)-f(a)F(a)$ y así tenemos

$$A = \sum_{k=1}^n f(t_k)F(t_k) - \sum_{k=1}^n f(t_{k-1})F(t_{k-1})$$

si restamos estas dos desigualdades tendremos

$$A - R_f(F, P) = \sum_{k=1}^n f(t_k)[F(t_k) - F(x_k)] + \sum_{k=1}^n f(t_{k-1})[F(x_k) - F(t_{k-1})]$$

las dos sumas de la derecha pueden combinarse en una sola suma de la forma $R_f(f, P')$, donde P' es la partición de $[a, b]$ que se obtiene al agregarle a P , los puntos x_k . Así P' es más fina que P y por tanto más fina que P_C . Por lo que la desigualdad (1) es válida y tenemos

$$|A - R_f(F, P) - (R-S) \int_a^b f dF| < \epsilon$$

siempre que $P_C \subseteq P$, y de acuerdo a la definición tenemos

$$(R-S) \int_a^b f dF = A - (R-S) \int_a^b f dF. //$$

El siguiente resultado nos da una forma de reducir una integral de Riemann-Stieltjes a una integral de Riemann.

Teorema 2.1.3.- Sea $f \in R(F)$ en $[a, b]$. Si F tiene derivada F' continua en $[a, b]$, entonces la integral de Riemann $(R) \int_a^b f(x)F'(x)dx$ existe y se tiene

$$(R-S) \int_a^b f(x) dF(x) = (R) \int_a^b f(x) F'(x) dx$$

Demostración.- Tomemos $g(x)=f(x)F'(x)$ y consideremos la suma de Riemann

$$R(g, p) = \sum_{k=1}^n g(x_k) [t_k - t_{k-1}] = \sum_{k=1}^n f(x_k) F'(x_k) (t_k - t_{k-1})$$

la misma partición p y la misma elección de x_k puede utilizarse para la suma de Riemann-Stieltjes

$$R_F(f, p) = \sum_{k=1}^n f(x_k) \cdot [F(t_k) - F(t_{k-1})].$$

Aplicando el teorema del valor medio podemos escribir

$$F(t_k) - F(t_{k-1}) = F'(v_k) (t_k - t_{k-1}) \text{ donde } v_k \in (t_{k-1}, t_k)$$

y así

$$R_F(f, p) - R(g, p) = \sum_{k=1}^n f(x_k) [F'(v_k) - F'(x_k)] (t_k - t_{k-1})$$

ya que f es acotada, tenemos $M > 0$ tal que $|f(x)| \leq M$ para todo $x \in [a, b]$. Ya que F' es continua en $[a, b]$ entonces es uniformemente continua. Así, dado $\epsilon > 0$, hay un $\delta > 0$ tal que

$$0 \leq |x - y| < \delta \text{ implica } |F'(x) - F'(y)| < \frac{\epsilon}{2M(b-a)}$$

si tomamos una partición P'_ϵ de norma $|P'_\epsilon| < \delta$, entonces para cualquier partición más fina P tendremos en la igualdad anterior

$$|F'(v_k) - F'(x_k)| < \frac{\epsilon}{2M(b-a)}$$

y para tal P tenemos

$$|R_f(f,P) - R(g,P)| < \epsilon/2$$

por otro lado ya que $f \in R(F)$ en $[a,b]$, existe una partición P''_ϵ tal que si $P \leq P''_\epsilon$ entonces

$$|R_f(f,P) - (R-S) \int_a^b f dF| < \epsilon/2$$

y combinando estas 2 últimas desigualdades, vemos que para P mas fina que $P_\epsilon = P'_\epsilon \cup P''_\epsilon$, tendremos

$$|R(g,P) - (R-S) \int_a^b f dF| < \epsilon$$

lo que demuestra el teorema. //

Es claro que si F es constante en $[a,b]$ toda suma $R_f(f,P) = 0$ y así $(RS) \int_a^b f dF$ existe, y tiene el valor cero.

Un caso más interesante es cuando F es constante excepto en un punto c del intervalo, donde presenta una discontinuidad de salto. En este caso, la integral no necesariamente existe y si existe no necesariamente vale cero. Esto es lo que nos afirma el siguiente teorema.

Teorema 2.1.4.- Dados $a < c < b$. Definimos F en $[a,b]$ como sigue: Los valores $F(a)$, $F(c)$, $F(b)$ son arbitrarios; $F(x) = F(a)$ si $a \leq x < c$ y $F(x) = F(b)$ si $c < x \leq b$. Sea f definida en $[a,b]$ de manera que por lo menos una de las funciones f o F sea continua por la izquierda en c y una por lo menos sea continua por la derecha en c. Entonces $f \in R(F)$ en $[a,b]$ y tenemos

$$\int_a^b f dF = f(c) [F(c^+) - F(c^-)]$$

Demostración. - Si $c \in P$, todo término de la suma $R_F(f, P)$ es nulo salvo los dos términos procedentes del subintervalo que contiene a por c , pongamos pues

$$R_F(f, P) = f(x_{k-1}) [F(c) - F(c^-)] + f(x_k) [F(c^+) - F(c)]$$

donde $t_{k-1} \leq c \leq t_k$ igualdad que también podemos escribir

$$\Delta = [f(x_{k-1}) - f(c)] [F(c) - F(c^-)] + [f(x_k) - f(c)] [F(c^+) - F(c)]$$

con $\Delta = R_F(f, P) - f(c)[F(c^+) - F(c^-)]$. Luego tenemos

$$|\Delta| \leq |f(x_{k-1}) - f(c)| |F(c) - F(c^-)| + |f(x_k) - f(c)| |F(c^+) - F(c)|$$

Si f es continua en c , para todo $\epsilon > 0$ existe un $\delta > 0$ tal que $|P| < \delta$ implica

$$|f(x_{k-1}) - f(c)| < \epsilon \quad \text{y} \quad |f(x_k) - f(c)| < \epsilon$$

En este caso, obtenemos la desigualdad

$$|\Delta| \leq \epsilon |F(c) - F(c^-)| + \epsilon |F(c^+) - F(c)| \quad (2)$$

pero esta desigualdad es válida sea f continua o no en c por ejemplo, si f es discontinua a la derecha y a la izquierda de c , entonces $F(c) = F(c^-)$ y $F(c) = F(c^+)$ y conseguimos $\Delta = 0$. Por otra parte, si f es continua a la izquierda y discontinua a la derecha de c , debemos tener $F(c) = F(c^+)$ y obtenemos $|\Delta| \leq \epsilon |F(c) - F(c^-)|$. Análogamente si f es continua a la derecha y discontinua

a la izquierda de c , tenemos $F(c)=F(c^-)$ y $|\Delta| \leq \varepsilon |F(c^+)-F(c^-)|$ luego (2) es válida en cualquier caso, lo que demuestra el teorema. //

2.2. INTEGRAL DE DARBOUX-STIELTJES.

Definición 2.2.1.- Sea F una función monótona creciente en $[a,b]$ y sea $P=\{a=t_0 < t_1 < \dots < t_n=b\}$ una partición de $[a,b]$. Adoptando la notación dada en 1.1.2, para toda función real f acotada en $[a,b]$ definimos la suma superior de Darboux-Stieltjes de f con respecto a F y a la partición P de $[a,b]$ como

$$S_F(f,P) = \sum_{k=1}^n M(f, [t_{k-1}, t_k]) \cdot [F(t_k) - F(t_{k-1})],$$

y la suma inferior de Darboux-Stieltjes de f respecto a F y a la partición P de $[a,b]$ como

$$I_F(f,P) = \sum_{k=1}^n m(f, [t_{k-1}, t_k]) \cdot [F(t_k) - F(t_{k-1})].$$

La integral superior de Darboux-Stieltjes, y la integral inferior de Darboux-Stieltjes son

$$S_F(f) = \inf \{S_F(f,P) : P \text{ es partición de } [a,b]\}$$

$$I_F(f) = \sup \{I_F(f,P) : P \text{ es partición de } [a,b]\}$$

si las integrales superior e inferior coinciden entonces se dice que f es Darboux-Stieltjes integrable y la integral de Darboux-Stieltjes es dada por el valor común:

$$(DS) \int_a^b f dF = S_F(f) = I_F(f).$$

Si la integral existe, esto es, si $S_F(f) = I_F(f)$ decimos que f es integrable con respecto a F en el sentido de Darboux-Stieltjes y escribimos $f \in D(F)$ en $[a, b]$. Tomando $F(x) = x$ se ve que la integral de Darboux (1.1) es un caso particular de la integral de Darboux-Stieltjes.

Teorema 2.2.1.- Sea F creciente y f acotada en $[a, b]$. Si Q es un refinamiento de P es

$$I_F(f, P) \leq I_F(f, Q) \leq S_F(f, Q) \leq S_F(f, P)$$

Demostración. (Semejante a lo del lema (1.1.1)).//

Teorema. 2.2.2.- $I_F(f,) \leq S_F(f,)$

Demostración. (Semejante a la del teorema (1.1.1)).//

Teorema. 2.2.3.- $f \in D(F)$ en $[a, b]$ si, y solo si, para cada $\epsilon > 0$ existe una partición P tal que

$$S_F(f, P) - I_F(f, P) < \epsilon. \quad (1)$$

En este caso, decimos que f satisface la condición de Riemann respecto a F en $[a, b]$.

Demostración. Para cada partición P tenemos

$$I_F(f, P) \leq I_F(f) \leq S_F(f) \leq S_F(f, P)$$

así (1) implica

$$0 \leq S_F(f) - I_F(f) < \varepsilon$$

por lo que si se cumple (1) para todo $\varepsilon > 0$ tenemos

$$S_F(f) = I_F(f)$$

Inversamente, supongamos que $f \in D(f)$ y sea $\varepsilon > 0$ dado. Existen particiones F_1 y P_2 tales que

$$S_F(f, P_2) - (DS) \int_a^b f dF < \frac{\varepsilon}{2}$$

$$(DS) \int_a^b f dF - I_F(f, P_1) < \frac{\varepsilon}{2}$$

tomando P como un refinamiento común de P_1 y P_2 , tenemos

$$S_F(f, P) \leq S_F(f, P_2) < (D-S) \int f dF + \frac{\varepsilon}{2} < I_F(f, P_1) + \varepsilon \leq I_F(f, P) + \varepsilon //$$

Teorema 2.2.4.- Sea F creciente, $f \in D(F)$, si y solo si $f \in R(F)$, en $[a, b]$ en cuyo caso las integrales coinciden.

Demostración: Necesidad. Sea P_ε una partición de $[a, b]$ tal que

$$S_F(f, P) - I_F(f, P) < \varepsilon,$$

para cada suma de Riemann-Stieltjes tenemos

$$I_F(f, P) \leq \sum_{k=1}^n f(x_k) \cdot [F(t_k) - F(t_{k-1})] \leq S_F(f, P)$$

y como

$$I_F(f, P) \leq (D-S) \int_a^b f dF \leq S_F(f, P)$$

tenemos que para P más fina que P_ϵ

$$\left| \sum_{k=1}^n f(x_k) \cdot [F(t_k) - F(t_{k-1})] - (D-S) \int_a^b f dF \right| < \epsilon$$

como $\epsilon > 0$ es arbitrario y la desigualdad es válida para toda P más fina que P_ϵ , por la definición 2.1.1. tenemos que $f \in R(F)$ y además se cumple

$$(R-S) \int_a^b f dF = (D-S) \int_a^b f dF.$$

Suficiencia. Supóngase que $f \in R(F)$ (definición 2.1.1.). sea $\epsilon > 0$. Seleccionemos una partición $P_\epsilon = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$ de tal forma que para cada P más fina que P_ϵ se tenga que

$$|R_F(f, P) - r| < \epsilon$$

y tomemos x_k en $[t_{k-1}, t_k]$ de modo que $f(x_k) < m(f, [t_{k-1}, t_k]) + \epsilon$

La suma de Riemann-Stieltjes para esta elección de los x_k satisface

$$R_F(f, P) < I_F(f, P) + \epsilon(b-a) \cdot [F(b) - F(a)]$$

y también

$$|R_F(f, P) - r| < \epsilon$$

por lo que

$$I_F(f) \geq I_F(f, P) > R_F(f, P) - \epsilon[F(b) - F(a)] > r - \epsilon - \epsilon[F(b) - F(a)]$$

puesto que ϵ es arbitrario, concluimos que

$$I_F(f) \geq r;$$

similarmente se llega a que

$$S_F(f) \leq r$$

por lo que se concluye que

$$I_F(f) = S_F(f) = r ;$$

esto es, que $f \in D(F)$ y además

$$(D-S) \int_a^b f dF = r = (R-S) \int_a^b f dF. //$$

Definición.- 2.2.2.- Sea f una función definida en $[a, b]$, si $P = \{t_0, t_1, \dots, t_n\}$ es una partición de $[a, b]$ escribimos $\Delta f_k = f(t_k) - f(t_{k-1})$, $k=1, 2, \dots, n$. Si existe un número positivo M tal que

$$\sum_{k=1}^n |\Delta f_k| \leq M$$

para todas las particiones de $[a, b]$, se dice que f es de variación acotada en $[a, b]$.

Definición 2.2.3.- Sea f de variación acotada en $[a, b]$, y designemos por $\sum(P)$ la suma $\sum_{k=1}^n |\Delta f_k|$ correspondiente a la partición $P = \{t_0, t_1, \dots, t_n\}$ de $[a, b]$, el número $v_f(a, b) = \text{SUP}\{\sum(P) : P \text{ es partición de } [a, b]\}$ se llama la variación total de f en el intervalo $[a, b]$.

Teorema 2.2.5.- Supongamos que F es de variación acotada en $[a, b]$ designemos por $V(x)$ la variación total de F en

$[a, x]$ si $a < x \leq b$ y tomemos $V(a)=0$. Sea f una función definida y acotada en $[a, b]$. Si $f \in D(F)$ en $[a, b]$, entonces $f \in D(V)$ en $[a, b]$.

Demostración. Si $V(b)=0$, V es constante y el resultado es trivial, supongamos por lo tanto que $V(b) > 0$. Supongamos también que $|f(x)| \leq M$ si $x \in [a, b]$. Puesto que V es creciente, necesitamos tan solo verificar que f satisface la condición de Riemann con respecto a V en $[a, b]$. Dado $\epsilon > 0$, elijamos P_ϵ de modo que para cualquier P más fina y todo par de puntos x_k y x'_k en $[t_{k-1}, t_k]$ se tenga

$$\left| \sum_{k=1}^n [f(x_k) - f(x'_k)] \Delta F_k \right| < \frac{\epsilon}{4} \text{ y } V(b) < \sum_{k=1}^n |\Delta F_k| + \frac{\epsilon}{4M}$$

para P más fino que P_ϵ estableceremos las dos desigualdades

$$\sum_{k=1}^n [M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) (\Delta V_k - |\Delta F_k|) < \frac{\epsilon}{2}$$

y

$$\sum_{k=1}^n [M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) |\Delta F_k| < \frac{\epsilon}{2}$$

que al sumarlos nos dan $S_v(f, P) - I_v(f, P) < \epsilon$ para demostrar la primer desigualdad, obsérvese que $\Delta V_k - |\Delta F_k| \geq 0$ y, por tanto

$$\sum_{k=1}^n [M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) (\Delta V_k - |\Delta F_k|) \leq 2M \sum_{k=1}^n$$

$$(\Delta V_k - |\Delta F_k|) = 2m(V(b) - \sum_{k=1}^n |\Delta F_k|) < \frac{\epsilon}{2}$$

para probar la segunda desigualdad, consideremos

$$A(P) = \{k / \Delta F_k \geq 0\}, B(P) = \{k / \Delta F_k < 0\} \text{ y}$$

$h = \frac{1}{4} \varepsilon / V(b)$. Si $k \in A(P)$ elijamos x_k y x'_k de forma que
 $f(x_k) - f(x'_k) > M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) - h$ pero si $k \in B(P)$,
 elijamos x_k y x'_k para que
 $f(x'_k) - f(x_k) > M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) - h$ entonces

$$\begin{aligned}
 \sum_{k=1}^n M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) |\Delta F_k| &< \sum_{k \in A(P)} [f(x_k) - f(x'_k)] |\Delta F_k| \\
 &+ \sum_{k \in B(P)} [f(x'_k) - f(x_k)] |\Delta F_k| + \\
 &h \sum_{k=1}^n |\Delta F_k| \\
 &= \sum_{k=1}^n [f(x_k) - f(x'_k)] |\Delta F_k| + h \sum_{k=1}^n |\Delta F_k| \\
 &< \frac{\varepsilon}{4} + hV(b) = \frac{\varepsilon}{4} + \frac{\varepsilon}{4} = \frac{\varepsilon}{2}
 \end{aligned}$$

por lo que se deduce que $f \in D(V)$ en $[a, b]$. //

Teorema 2.2.6.- Si f es continua en $[a, b]$ y F es de variación acotada en $[a, b]$, entonces $f \in D(F)$ en $[a, b]$.

Demostración. Es suficiente probar el teorema cuando F es estrictamente creciente. La continuidad de f en $[a, b]$ implica la continuidad uniforme, así que dado $\varepsilon > 0$, hay un $\delta > 0$ (que sólo depende de ε) tal que

$$|x - y| < \delta \text{ implica } |F(x) - F(y)| < \varepsilon |A$$

donde $\lambda = 2 ([F(b) - F(a)])$. Si P_ϵ es una partición de norma $|P_\epsilon| < \delta$, entonces para una P más fina que P_ϵ debe ser

$$M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) \leq \epsilon / \lambda$$

ya que $M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) = \sup\{f(x) - f(y) / x, y \in [t_{k-1}, t_k]\}$

multiplicando la desigualdad por ΔF_k y sumando, encontramos

$$S_F(f, P) - I_F(f, P) \leq \frac{\epsilon}{\lambda} \sum_{k=1}^n \Delta F_k = \frac{\epsilon}{2} \leq \epsilon$$

y puesto que se satisface la condición de Riemann concluimos que $f \in D(F)$ en $[a, b]$. //

Teorema 2.2.7.- Cada una de las siguientes condiciones es suficiente para la existencia de la integral de Riemann $(R) \int_a^b f(x) dx$

- a) f continua en $[a, b]$
- b) f de variación acotada en $[a, b]$

Demostración.- aplicando $F(x) = x$ y aplicando el teorema anterior, y la integración por partes. //

Teorema 2.2.8.- Supongamos que F es creciente en $[a, b]$ y sea $a < c < b$. Supongamos además que f y F son ambas continuas a la derecha de $x = c$, esto es, supongamos que existe un $\epsilon > 0$ tal que para toda $\delta > 0$ hay valores de x e y en el intervalo $(c, c + \delta)$ para los cuales

$$|f(x) - f(c)| \geq \epsilon \quad \text{y} \quad |F(y) - F(c)| \geq \epsilon$$

en tal caso no puede existir la integral (R-S) $\int_a^b f(x)dF(x)$ tampoco existe si f y F son discontinuas a la izquierda de c .

Demostración. Sea P una partición de $[a,b]$ que contiene a c como un punto de subdivisión y formemos la diferencia

$$S_F(f,P) - I_F(f,P) = \sum_{k=1}^n \left[M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) \right] \Delta F_k$$

si el i -ésimo subintervalo tiene c como extremo izquierdo entonces

$$S_F(f,P) - I_F(f,P) \geq \left[M(f, [t_{i-1}, t_i]) - m(f, [t_{i-1}, t_i]) \right] \left[F(t_i) - F(c) \right]$$

puesto que cada término de la suma es ≥ 0 . Si c es una discontinuidad común a la derecha, podemos suponer que el punto x_i se elige de manera que $F(x_i) - F(c) \geq \varepsilon$ además, la hipótesis del teorema implica $M(f, [t_{i-1}, t_i]) - m(f, [t_{i-1}, t_i]) \geq \varepsilon$ luego $S_F(f,P) - I_F(f,P) \geq \varepsilon^2$ y no puede satisfacerse la condición de Riemann. (Si c es una discontinuidad común a la izquierda, el razonamiento es análogo.//

CAPITULO 3
OTRO TRATAMIENTO DE LA INTEGRAL DE RIEMANN-STIELTJES

3.1 LA INTEGRAL DE DARBOUX-STIELTJES GENERALIZADA.

Supondremos en todo el capítulo que F es una función creciente en $[a, b]$, con $F(a) < F(b)$. Usaremos la notación siguiente para los límites laterales (además de la ya establecida en 1.1):

$$F(t^-) = \lim_{x \rightarrow t^-} F(x) \quad \text{y} \quad F(t^+) = \lim_{x \rightarrow t^+} F(x)$$

para los extremos, por facilidad de notación definiremos

$$F(a^-) = F(a) \quad \text{y} \quad F(b^+) = F(b).$$

Nótese que $F(t^-) \leq F(t^+)$ para toda $t \in [a, b]$. Cuando F es continua en t , tenemos $F(t^-) = F(t^+) = F(t)$. De otra forma $F(t^-) < F(t^+)$ y la diferencia $F(t^+) - F(t^-)$ es llamado el salto de F en t .

Definición 3.1.1.- Sean f una función real acotada en $[a, b]$ y una partición $P = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$ escribiremos

$$J_F(f, P) = \sum_{k=0}^{n-1} f(t_k) [F(t_{k+1}^+) - F(t_k^-)]$$

La suma superior de Darboux-Stieltjes generalizada es

$$S_F^+(f, P) = J_F(f, P) + \sum_{k=1}^n M(f, (t_{k-1}, t_k)) \cdot [F(t_k^-) - F(t_{k-1}^+)]$$

y la suma inferior de Darboux-Stieltjes generalizada

$$I_F^-(f, P) = J_F(f, P) + \sum_{k=1}^n m(f, (t_{k-1}, t_k)) \cdot [F(t_k^-) - F(t_{k-1}^+)].$$

Obsérvese que estas definiciones toman en cuenta los efectos del salto de F . Nótese además

$$\begin{aligned} & S_F^+(f, P) - I_F^-(f, P) \\ &= \sum_{k=1}^n [M(f, (t_{k-1}, t_k)) - m(f, (t_{k-1}, t_k))] [F(t_k^-) - F(t_{k-1}^+)] \end{aligned} \quad (1)$$

y

$$\begin{aligned} m(f, [a, b]) \cdot [F(b) - F(a)] &= I_F^+(f, P) \leq S_F^+(f, P) \\ &\leq M(f, [a, b]) \cdot [F(b) - F(a)]. \end{aligned} \quad (2)$$

puesto que

$$\sum_{k=0}^n [F(t_k^+) - F(t_k^-)] + \sum_{k=1}^n [F(t_k^-) - F(t_{k-1}^+)] = F(b^+) - F(a^-) = F(b) - F(a)$$

La integral superior de Darboux-Stieltjes generalizada es

$$S_F^+(f) = \inf \{ S_F^+(f, P) : P \text{ es una partición de } [a, b] \}$$

y la integral inferior de Darboux-Stieltjes generalizada

$$I_F^-(f) = \sup \{ I_F^-(f, P) : P \text{ es una partición de } [a, b] \}$$

Mostraremos más adelante que $I_F^\circ(f) \leq S_F^\circ(f)$. Por consiguiente diremos que f es Darboux-Stieltjes integrable en el sentido generalizado, en $[a, b]$ con respecto a F , o más brevemente F -integrable en $[a, b]$, si $I_F^\circ(f) = S_F^\circ(f)$, en cuyo caso escribiremos

$$\int_a^b f dF = \int_a^b f(x) dF(x) = I_F^\circ(f) = S_F^\circ(f).$$

Lema 3.1.1.- Sea f una función acotada sobre $[a, b]$, y sean P y Q particiones de $[a, b]$ tal que $P \leq Q$. Entonces

$$I_F^\circ(f, P) \leq I_F^\circ(f, Q) \leq S_F^\circ(f, Q) \leq S_F^\circ(f, P).$$

Demostración.- La desigualdad central es obvia, las pruebas de las desigualdades de la izquierda y de la derecha son semejantes a las del lema 1.1.1. Mostraremos que

$$S_F^\circ(f, Q) \leq S_F^\circ(f, P).$$

Basta con probar esta considerando que Q tiene exactamente un punto más, digamos u , que P , si

$$P = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$$

entonces

$$Q = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_{k-1} < u < t_k < \dots < t_n = b\}$$

para alguna $k \in \{1, 2, \dots, n\}$. Encontramos que

$$\begin{aligned} S_F^\circ(f, P) - S_F^\circ(f, Q) &= M(f, (t_{k-1}, t_k) \cdot [F(t_k^-) - F(t_{k-1}^+)] \\ &\quad - \{f(u) \cdot [F(u^+) - F(u^-)] + M(f, (t_{k-1}, u)) \cdot [F(u^-) - F(t_{k-1}^+)] \\ &\quad + M(f, (u, t_k)) \cdot [f(t_k^-) - F(u^+)]\} \end{aligned}$$

y esta es no negativa porque

$$\begin{aligned}
 & M(f, (t_{k-1}, t_k)). [F(t_k^-) - F(t_{k-1}^+)] \\
 = & M(f, (t_{k-1}, t_k)). [F(t_k^-) - F(u^+) + F(u^+) - F(u^-) + F(u^-) - F(t_{k-1}^+)] \\
 \cong & M(f, (u, t_k)). [F(t_k^-) - F(u^+)] + f(u)[F(u^+) - F(u^-)] \\
 + & M(f, (t_{k-1}, u)). [F(u^-) - F(t_{k-1}^+)]. //
 \end{aligned}$$

Lema 3.1.2.- Si f es una función acotada en $[a, b]$ y si P y Q son particiones de $[a, b]$, entonces $I_F^+(f, P) \leq I_F^+(f, Q)$

Demostración.- $P_0 = PUQ$ es también una partición de $[a, b]$ y como $P \leq P_0$, $Q \leq P_0$; concluimos por el lema 3.1.1.

$$I_F^+(f, P) \leq I_F^+(f, P_0) \leq S_F^+(f, P_0) \leq S_F^+(f, Q) //$$

Teorema 3.1.1.- Para toda función acotada f sobre $[a, b]$, tenemos $I_F^+(f) \leq S_F^+(f)$.

Demostración.- Tomemos una partición fija P . El lema 3.1.2 nos asegura que $I_F^+(f, P)$ es una cota inferior para el conjunto

$$\{S_F^+(f, Q) : Q \text{ es partición de } [a, b]\}$$

por lo que $I_F^+(f, P)$ debe ser menor o igual que la máxima cota inferior del conjunto, por lo que $I_F^+(f, P) \leq S_F^+(f)$. Y de aquí se sigue inmediatamente la conclusión. //

El siguiente resultado nos da un criterio de integrabilidad.

Teorema 3.1.2.- Una función real f , acotada sobre $[a,b]$, es F-integrable si, y solo si, para cada $\epsilon > 0$, existe una partición P de $[a,b]$, tal que

$$S_F^\circ(f,P) - I_F^\circ(f,P) < \epsilon.$$

Demostración.- Necesidad: Supóngase que f es F-integrable, existen entonces P_1 y P_2 , particiones de $[a,b]$, con

$$I_F^\circ(f,P_1) > I_F^\circ(f) - \epsilon/2 \quad \text{y} \quad S_F^\circ(f,P_2) < S_F^\circ(f) + \epsilon/2$$

tomando $P = P_1 \cup P_2$ tenemos

$$I_F^\circ(f,P_1) \leq I_F^\circ(f,P) \leq S_F^\circ(f,P) \leq S_F^\circ(f,P_2)$$

y

$$\begin{aligned} S_F^\circ(f,P) - I_F^\circ(f,P) &\leq S_F^\circ(f,P_2) - I_F^\circ(f,P_1) \\ &\leq S_F^\circ(f) + \epsilon/2 - I_F^\circ(f) + \epsilon/2 \\ &= S_F^\circ(f) - I_F^\circ(f) + \epsilon \end{aligned}$$

y puesto que f es F-integrable $S_F^\circ(f) = I_F^\circ(f)$, $S_F^\circ(f,P) - I_F^\circ(f,P) < \epsilon$

Suficiencia. Supongamos que para cada $\epsilon > 0$ se cumple que

$$S_F^\circ(f,P) - I_F^\circ(f,P) < \epsilon$$

tenemos

$$\begin{aligned} S_F^\circ(f) \leq S_F^\circ(f,P) &= S_F^\circ(f,P) - I_F^\circ(f,P) + I_F^\circ(f,P) \\ &\leq \epsilon + I_F^\circ(f,P) \leq \epsilon + I_F^\circ(f) \end{aligned}$$

por ser ϵ arbitrario $S_F^\circ(f) \leq I_F^\circ(f)$ por lo que el teorema 3.1.1 nos permite concluir

$$I_F^\circ(f) = S_F^\circ(f) \quad (\text{i.e., } f \text{ es F-integrable}). //$$

Pasaremos a analizar algunas de las propiedades de esta integral.

Teorema 3.1.3. (linealidad).- Sean f y g funciones F -integrables sobre $[a,b]$, y sea c un número real. Entonces

a) cf es F -integrable y $\int_a^b (cf) dF = c \int_a^b f dF$

b) $f + g$ es F -integrable y $\int_a^b (f+g) dF = \int_a^b f dF + \int_a^b g dF$

Demostración.- De (a), consideremos por casos, $c > 0$, $c = -1$ y $c < 0$, $c = 0$ es obvio.

i) Sea $c > 0$, consideremos una partición P de $[a,b]$. Por las propiedades del supremum tenemos $M(cf, [t_{k-1}, t_k]) = cM(f, [t_{k-1}, t_k])$ y así $S_F^{\circ}(cf, P) = cS_F^{\circ}(f, P)$, por el mismo criterio $S_F^{\circ}(cf) = cS_F^{\circ}(f)$. Por lo anterior y dado que f es F -integrable

$$I_F^{\circ}(cf) = c I_F^{\circ}(f) = c S_F^{\circ}(f) = S_F^{\circ}(cf)$$

i.e cf es F -integrable y $\int_a^b c f dF = c \int_a^b f dF$.

ii) $c = -1$, para todas las particiones P de $[a,b]$ tenemos $S_F^{\circ}(-f, P) = -I_F^{\circ}(f, P)$ por lo que

$$S_F^{\circ}(-f) = \inf \{S_F^{\circ}(-f, P) : P \text{ es partición de } [a,b]\}$$

$$= \inf \{-I_F^{\circ}(f, P) : P \text{ es partición de } [a,b]\}$$

$$= -\text{SUP} \{I_F^{\circ}(f, P) : P \text{ es partición de } [a,b]\} = -I_F^{\circ}(f)$$

sustituyendo f por $-f$, obtenemos que $I_F^{\circ}(-f) = -S_F^{\circ}(f)$, y ya que f es F -integrable

$S_F^{\circ}(-f) = -I_F^{\circ}(f) = -S_F^{\circ}(f) = I_F^{\circ}(-f)$ por lo que $-f$ es F -integrable y $\int_a^b (-f) dF = -\int_a^b f dF$.

iii) $c < 0$, aplicando los resultados probados a $-c$ obtenemos $\int_a^b c f dF = -\int_a^b (-c) f dF = -(-c) \int_a^b f dF = c \int_a^b f dF$

Prueba de (b).

Sea $c > 0$ y P_1, P_2 particiones de $[a, b]$ tales que

$$S_F^{\circ}(f, P_1) - I_F^{\circ}(f, P_1) < \epsilon/2 \quad \text{y} \quad S_F^{\circ}(g, P_2) - I_F^{\circ}(g, P_2) < \epsilon/2$$

esto por la integrabilidad de f y g . Tomemos $P = P_1 \cup P_2$, por el lema 3.1.1 tenemos que

$$S_F^{\circ}(f, P) - I_F^{\circ}(f, P) < \epsilon/2 \quad \text{y} \quad S_F^{\circ}(g, P) - I_F^{\circ}(g, P) < \epsilon/2. \quad (3)$$

Para cualquier subconjunto C de $[a, b]$ tenemos que

$$\inf \{f(x) + g(x) : x \in C\} \geq \inf \{f(x) : x \in C\} + \inf \{g(x) : x \in C\}$$

por lo que

$$I_F^{\circ}(f+g, P) \geq I_F^{\circ}(f, P) + I_F^{\circ}(g, P)$$

De forma similar

$$S_F^{\circ}(f+g, P) \leq S_F^{\circ}(f, P) + S_F^{\circ}(g, P)$$

y por (3) tenemos

$$S_F^*(f+g, P) - I_F^*(f+g, P) < \varepsilon$$

esto es, $(f+g)$ es F -integrable. Puesto que

$$\begin{aligned} \int_a^b (f+g) dF &= S_F^*(f+g) \leq S_F^*(f+g, P) \leq S_F^*(f, P) + S_F^*(g, P) \\ &< I_F^*(f, P) + I_F^*(g, P) + \varepsilon \leq I_F^*(f) + I_F^*(g) + \varepsilon \\ &= \int_a^b f dF + \int_a^b g dF + \varepsilon \end{aligned}$$

y también

$$\begin{aligned} \int_a^b (f+g) dF &= I_F^*(f+g) \geq I_F^*(f+g, P) \geq I_F^*(f, P) + I_F^*(g, P) \\ &\geq S_F^*(f, P) + S_F^*(g, P) - \varepsilon = \int_a^b f dF + \int_a^b g dF - \varepsilon \end{aligned}$$

y concluimos que

$$\int_a^b (f+g) dF = \int_a^b f dF + \int_a^b g dF \quad .//$$

Teorema 3.1.4. (aditividad).- Sea f definida en $[a, b]$. Si $a < c < b$ y f es F -integrable en $[a, c]$ y en $[c, b]$, entonces es F -integrable en $[a, b]$ y

$$\int_a^b f dF = \int_a^c f dF + \int_c^b f dF$$

Demostración.- Puesto que f es acotada en $[a, c]$ y $[c, b]$, es acotada en $[a, b]$. Sea $\varepsilon > 0$, hay particiones P_1 y P_2 de $[a, c]$ y $[c, b]$ tales que

$$S_{F, [a, c]}^*(f, P_1) - I_{F, [a, c]}^*(f, P_1) < \varepsilon/2 \quad \text{y}$$

$$S_{F, [c, b]}^{\circ}(f, P_2) - I_{F, [c, b]}^{\circ}(f, P_2) < \varepsilon/2$$

El conjunto $P=P_1 \cup P_2$ es una partición de $[a, b]$ para la cual

$$S_{F, [a, b]}^{\circ}(f, P) = S_{F, [a, c]}^{\circ}(f, P_1) + S_{F, [c, b]}^{\circ}(f, P_2)$$

(por la definición de los límites laterales para los extremos, solo se incluye una sola vez y el salto en c)

$$I_{F, [a, b]}^{\circ}(f, P) = I_{F, [a, c]}^{\circ}(f, P_1) + I_{F, [c, b]}^{\circ}(f, P_2)$$

por lo que f es F -integrable en $[a, b]$, por el teorema 3.1.2 y

$$\int_a^b f dF \leq S_{F, [a, b]}^{\circ}(f, P) = S_{F, [a, c]}^{\circ}(f, P_1) + S_{F, [c, b]}^{\circ}(f, P_2)$$

$$< I_{F, [a, c]}^{\circ}(f, P_1) + I_{F, [c, b]}^{\circ}(f, P_2) + \varepsilon \leq \int_a^c f dF + \int_a^b f dF + \varepsilon$$

similarmente

$$\int_a^b f dF > \int_a^c f dF + \int_c^b f dF - \varepsilon$$

al ser ε arbitraria tenemos $\int_a^b f dF = \int_a^c f dF + \int_c^b f dF$. //

Teorema 3.1.5.- Si f y g son F -integrables sobre $[a, b]$ y si $f(x) \leq g(x)$ para $x \in [a, b]$, entonces $\int_a^b f dF \leq \int_a^b g dF$.

Demostración: Tomemos $h=g-f$, así h es F -integrable en $[a, b]$ Puesto que $h(x) \geq 0$ para toda $x \in [a, b]$, $I_F^{\circ}(h, P) \geq 0$ para toda partición P , y así

$$\int_a^b h dF = I_F^*(h) \geq 0$$

por el teorema 3.1.3.

$$\int_a^b g dF - \int_a^b f dF = \int_a^b h dF \geq 0,$$

lo que verifica el teorema. //

Teorema 3.1.6.- Si f es F -integrable en $[a, b]$, entonces $|f|$ es F -integrable y $|\int_a^b f dF| \leq \int_a^b |f| dF$

Demostración: Para cualquier subconjunto C es de $[a, b]$ tenemos $M(|f|, C) - m(|f|, C) \leq M(f, C) - m(f, C)$ por lo que para toda P tenemos

$$S_F^*(|f|, P) - I_F^*(|f|, P) \leq S_F^*(f, P) - I_F^*(f, P) < \epsilon$$

la última desigualdad por ser f F -integrable. Queda así demostrado que $|f|$ es F -integrable, ahora como $-|f| \leq f \leq |f|$, el teorema 3.1.5 nos da

$$-\int_a^b |f| dF \leq \int_a^b f dF \leq \int_a^b |f| dF$$

lo que demuestra el teorema. //

Teorema 3.1.7.- Sea F_1 y F_2 funciones crecientes sobre $[a, b]$, si f es F_1 -integrable y F_2 -integrable sobre $[a, b]$ y si $c > 0$, entonces f es cF_1 -integrable, y es $(F_1 + F_2)$ -integrable; además

$$\int_a^b f d(cF_1) = c \int_a^b f dF \tag{4}$$

y

$$\int_a^b f d(F_1+F_2) = \int_a^b f dF_1 + \int_a^b f dF_2 \quad (5)$$

Demostración: Utilizando las propiedades de límites, tenemos que $(F_1+F_2)(t^+) = \lim_{x \rightarrow t^+} [F_1(x)+F_2(x)] = \lim_{x \rightarrow t^+} F_1(x) + \lim_{x \rightarrow t^+} F_2(x) = F_1(t^+) + F_2(t^+)$

y de forma semejante para $(F_1+F_2)(t^-)$, $(cF_1)(t^+)$ y $(cF_1)(t^-)$ por lo que para toda partición P de $[a, b]$, tenemos

$$\begin{aligned} S_{F_1+F_2}^{\circ}(f, P) &= S_{F_1}^{\circ}(f, P) + S_{F_2}^{\circ}(f, P) \\ I_{F_1+F_2}^{\circ}(f, P) &= I_{F_1}^{\circ}(f, P) + I_{F_2}^{\circ}(f, P) \\ S_{cF_1}^{\circ}(f, P) &= c S_{F_1}^{\circ}(f, P) \text{ y } I_{cF_1}^{\circ}(f, P) = c I_{F_1}^{\circ}(f, P) \end{aligned} \quad (6)$$

de donde es claro la validez de (4). Existe una partición P de $[a, b]$ tal que $S_{F_1}^{\circ}(f, P) - I_{F_1}^{\circ}(f, P) < \epsilon/2$ y $S_{F_2}^{\circ}(f, P) - I_{F_2}^{\circ}(f, P) < \epsilon/2$

de aquí que, utilizando (6) tenemos que (5) se sigue de

$$S_{F_1+F_2}^{\circ}(f, P) - I_{F_1+F_2}^{\circ}(f, P) < \epsilon$$

por lo que f es (F_1+F_2) -integrable, así

$$\begin{aligned} \int_a^b f d(F_1+F_2) &\leq S_{F_1+F_2}^{\circ}(f, P) \leq I_{F_1+F_2}^{\circ}(f, P) + \epsilon \\ &= I_{F_1}^{\circ}(f, P) + I_{F_2}^{\circ}(f, P) + \epsilon \leq \int_a^b f dF_1 + \int_a^b f dF_2 + \epsilon \end{aligned}$$

y similarmente

$$\int_a^b f d(F_1 + F_2) > \int_a^b f dF_1 + \int_a^b f dF_2 - \varepsilon. //$$

Teorema 3.1.8.- Toda función continua f en $[a,b]$ es F -integrable.

Demostración.- f es uniformemente continua en el cerrado $[a,b]$, por lo que para $\varepsilon > 0$, existe $\delta > 0$ tal que

$$x, y \in [a,b] \text{ y } |x-y| < \delta \text{ implica que } |f(x) - f(y)| < \frac{\varepsilon}{F(b) - F(a)} \quad (7)$$

Consideremos cualquier partición P con $|P| < \delta$. Puesto que f toma su máximo y su mínimo sobre cada subintervalo $[t_{k-1}, t_k]$, se sigue de (7) que

$$M(f, [t_{k-1}, t_k]) - m(f, [t_{k-1}, t_k]) < \frac{\varepsilon}{F(b) - F(a)}$$

para cada valor de k . Por (1) en la definición 3.1.1. tenemos

$$S_F^*(f, P) - I_F^*(f, P) \leq \sum_{k=1}^n \frac{\varepsilon}{F(b) - F(a)} [F(t_k) - F(t_{k-1})] \leq \varepsilon$$

por lo que f es F -integrable. //

El siguiente teorema nos da un mecanismo para calcular un gran número de "F-integrales" usando integrales ordinarias de Riemann.

Teorema 3.1.9 Supóngase que F es diferenciable sobre $[a,b]$ y que F' es continua sobre $[a,b]$. Si f es continua sobre $[a,b]$, entonces

$$\int_a^b f dF = \int_a^b f(x)F'(x)dx.$$

Demostración. Tenemos que fF' es Riemann-Integrable y f es F -integrable, por lo que existe una partición $P=\{a=t_0 < t_1 < \dots < t_n=b\}$ tal que

$$S(fF', P) - I(fF', P) < \varepsilon/2 \quad \text{y} \quad S_F^*(f, P) - I_F^*(f, P) < \varepsilon/2 \quad (8)$$

Aplicando el teorema del valor medio a F sobre cada $[t_{k-1}, t_k]$, existe $x_k \in (t_{k-1}, t_k)$ para el cual $F(t_k) - F(t_{k-1}) = F'(x_k)(t_k - t_{k-1})$, por lo que

$$\sum_{k=1}^n f(x_k) \cdot [F(t_k) - F(t_{k-1})] = \sum_{k=1}^n f(x_k)F'(x_k) \cdot (t_k - t_{k-1})$$

Dado que F es continua, no presenta saltos y por la igualdad anterior

$$I_F^*(f, P) \leq S(fF', P) \quad \text{y} \quad I(fF', P) \leq S_F^*(f, P)$$

Ahora, de (8),

$$\int_a^b f dF \geq I_F^*(f, P) \geq S_F^*(f, P) - \varepsilon/2 \geq I(fF', P) - \varepsilon/2$$

$$> S(fF', P) - \varepsilon/2 - \varepsilon/2 \geq (R) \int_a^b f(x)F'(x)dx - \varepsilon$$

De manera semejante $\int_a^b f dF < (R) \int_a^b f(x)F'(x)dx + \varepsilon$. Puesto que $\varepsilon > 0$ es arbitrario, se cumple el teorema. //

Teorema 3.1.10. Toda función f monótona en $[a,b]$ es F -integrable

Demostración: Podemos suponer que f es creciente. Dado que $f(a) \leq f(x) \leq f(b)$ para toda $x \in [a,b]$, f es acotada sobre $[a,b]$. Para $\varepsilon > 0$ aplicamos el lema A.2 del apéndice para obtener $P = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$ donde, para $k=1, 2, \dots, n$

$$f(t_k^-) - f(t_{k-1}^+) < \frac{\varepsilon}{F(b) - F(a)} \quad \text{y} \quad m(f, (t_{k-1}, t_k)) = f(t_{k-1}^+)$$

Puesto que

$$M(f, (t_{k-1}, t_k)) = f(t_k^-) \quad \text{y} \quad m(f, (t_{k-1}, t_k)) = f(t_{k-1}^+)$$

Tenemos

$$\begin{aligned} S_F^*(f, P) - I_F^*(f, P) &= \sum_{k=1}^n [f(t_k^-) - f(t_{k-1}^+)] \cdot [F(t_k) - F(t_{k-1}^+)] \\ &< \sum_{k=1}^n \frac{\varepsilon}{F(b) - F(a)} [F(t_k) - F(t_{k-1}^+)] \leq \varepsilon \end{aligned}$$

por lo que concluimos que f es F -integrable

3.2. COMPARACION CON LA TEORIA CLASICA.

Antes de entrar a los teoremas, analizaremos algunas de las ventajas que nos proporciona el tratamiento generalizado respecto al clásico usual.

En la teoría clásica encontramos rápidamente ejemplos desafortunados: " f no es integrable respecto a F si ambas tienen un punto de discontinuidad común".

Ejemplo 3.2.1.
definamos

Sea el intervalo $[a, b]$ fijo y

$$\delta_u(t) = \begin{cases} 0 & \text{para } t < u \\ 1 & \text{para } t \geq u \end{cases}$$

para $u > a$; y hagamos

$$\delta_a(t) = \begin{cases} 0 & \text{para } t = a \\ 1 & \text{para } t > a \end{cases}$$

Si $f = F = \delta_u$, entonces $(DS) \int_a^b f dF$ y $(RS) \int_a^b f dF$
no existen (teorema 2.1.4)

Por razones como ésta, es que se abandona la teoría clásica de Riemann-Stieltjes en favor de la integral de Lebesgue-Stieltjes que aplicada al ejemplo 3.2.1. nos da el valor de 1 para la integral; pero ésta requiere un conocimiento previo de la teoría de la medida.

Estos desagradables ejemplos desaparecen en el tratamiento de la integral generalizada que se presenta en la sección 3.1. que impone menos restricciones a las funciones tratadas, como demostraremos en los siguientes teoremas, en los que mostraremos que si F es una función escalonada, entonces todas las funciones acotadas son F -integrables

Ejemplo 3.2.2. Si v_1, u_2, \dots, u_m , son puntos distintos en $[a, b]$; c_1, c_2, \dots, c_m , son números positivos entonces

$$F = \sum_{j=1}^m c_j \delta_{u_j}$$

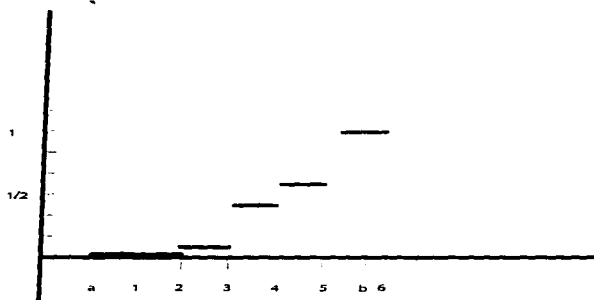
(donde δ_u es como en el ejemplo 1) es una función escalonada creciente con saltos c_j en u_j . Como caso particular podemos considerar

$0 < a \leq 1$, $b \geq 5$, $u_1=2$, $u_2=3$, $u_3=4$, $u_4=5$ y $c_1=1/12$, $c_2=1/3$, $c_3=1/6$, $c_4=5/12$.

La gráfica de ésta función está dada en la figura 3.1. Para cualquier función f acotada en $[a,b]$, tenemos

$$\int_a^b f dF = \frac{1}{12}f(2) + \frac{1}{3}f(3) + \frac{1}{6}f(4) + \frac{1}{12}f(5) \quad (\text{ver teorema 3.2.1.})$$

Figura 3.1



Teorema 3.2.1.- Sea P una función escalonada creciente con salto c_j en u_j . Entonces toda función acotada f en $[a,b]$ es F -integrable

y

$$\int_a^b f dF = \sum_{j=1}^m c_j f(u_j) \quad (1)$$

Demostración. Sea F la partición de $[a, b]$ que consiste de $[a, b]$ y todos los puntos u_1, u_2, \dots, u_m . Podemos suponer, sin pérdida de generalidad, que $a = u_1 < u_2 < \dots < u_m = b$. Entonces $F(u_j^+) - F(u_j^-) = c_j$ para $j = 1, 2, \dots, m$ y $F(u_j^-) - F(u_{j-1}^+) = 0$ para $j = 1, 2, \dots, m$. De aquí que

$$S_F^*(f, P) = I_F^*(f, P) = J_F(f, P) = \sum_{j=1}^m f(u_j) \cdot c_j$$

Por lo que concluimos que

$$S_F^*(f) = I_F^*(f) = \sum_{j=1}^m f(u_j) \cdot c_j$$

y las conclusiones del teorema. //

Teorema 3.2.2.- Sea (u_n) una sucesión en $[a, b]$ y sea (c_n) una sucesión sumable de números positivos. Sea $F = \sum_{n=1}^{\infty} c_n \delta_{u_n}$.

Entonces toda función acotada f en $[a, b]$ es F -integrable

$$\int_a^b f dF = \sum_{n=1}^{\infty} c_n f(u_n) \quad (2)$$

Demostración. Fijemos f y sea $B > 0$ una cota superior para $|f|$.

Considérese $\epsilon > 0$ y selecciónese un entero m tal que

$$\sum_{n=m+1}^{\infty} c_n < \varepsilon / (4B).$$

Sean

$$F_1 = \sum_{n=1}^m c_n \delta u_n \quad \text{y} \quad F_2 = \sum_{n=m+1}^{\infty} c_n \delta u_n$$

así que $F = F_1 + F_2$ y por el teorema 3.2.1., tenemos que

$$\int_a^b f dF_1 = \sum_{n=1}^m c_n f(u_n). \quad (3)$$

ya que

$$F_2(b) - F_2(a) = F_2(b) = \sum_{n=m+1}^{\infty} c_n < \varepsilon / (4B)$$

la desigualdad (2) en la definición 3.1.1. nos lleva a

$$-\frac{\varepsilon}{4} \leq I_2^*(f, P) \leq S_{F_2}^*(f, P) \leq \frac{\varepsilon}{4} \quad (4)$$

por lo que

$$S_{F_2}^*(f, P) - I_{F_2}^*(f, P) < \varepsilon / 2$$

para todas las particiones P de $[a, b]$. Si seleccionamos P tal que

$$S_{F_1}^*(f, P) - I_{F_1}^*(f, P) < \varepsilon / 2$$

entonces (6) en el teorema 3.1.7 y la igualdad $F = F_1 + F_2$ implican

$$S_F^*(f, P) - I_F^*(f, P) < \varepsilon$$

así es que f es F -integrable. De (4) tenemos que

$$\left| \int_a^b f dF_2 \right| \leq \epsilon/4.$$

por el teorema 3.1.7. y (3) tenemos que

$$\int_a^b f dF = \int_a^b f dF_1 + \int_a^b f dF_2 = \sum_{n=1}^{\infty} c_n f(u_n) - \sum_{n=m+1}^{\infty} c_n f(u_n) + \int_a^b f dF_2$$

puesto que

$$\left| \sum_{n=m+1}^{\infty} c_n f(u_n) \right| \leq B \sum_{n=m+1}^{\infty} c_n < \frac{\epsilon}{4}$$

por lo que concluimos que

$$\left| \int_a^b f dF - \sum_{n=1}^{\infty} c_n f(u_n) \right| < \frac{\epsilon}{2}$$

al ser ϵ arbitrario, tenemos la validez de (2).

El siguiente resultado no se cumple en la teoría clásica.//

Teorema 3.2.3.- Si f es F -integrable sobre $[a,b]$ y $g(x)=f(x)$ excepto para un número finito de puntos, entonces $g(x)$ es F -integrable.

Demostración.- Supongamos que $g(x)=f(x)$ excepto para un único punto $x=u$ en $[a,b]$, para $\epsilon > 0$ tenemos

$$S_F^*(f, P) - I_F^*(f, P) < \epsilon$$

para alguna $P = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$ por el lema 3.1.1, podemos agregar u a P sin invalidar la anterior desigualdad. Entonces $u = t_k$, para alguna k en $\{0, 1, 2, \dots, n\}$. Las sumas superior para f y g son iguales excepto para el término $k = \ell$ en J_F y así

$$S_F^+(f, P) - I_F^+(g, P) = f(u)[F(u^+) - F(u^-)] - g(u)[F(u^+) - F(u^-)]$$

El mismo argumento es aplicado a las sumas inferiores y así

$$I_F^-(f, P) - I_F^-(g, P) = S_F^-(f, P) - S_F^-(g, P).$$

de aquí que

$$S_F^+(g, P) - I_F^-(g, P) = S_F^+(f, P) - I_F^-(f, P) < \epsilon$$

por lo que g es F -integrable. //

Nótese que en el resultado anterior no se afirma que las integrales de f y g coinciden. El siguiente resultado se aplica a cualquier F no-decreciente.

Teorema 3.2.4.- Si f es seccionalmente continua o seccionalmente monótona y acotada sobre $[a, b]$, entonces f es F -integrable.

Demostración. Sea P una partición de $[a, b]$ tal que se satisface la hipótesis del teorema. Considérese un intervalo fijo $[t_{k-1}, t_k]$. Si f es seccionalmente continua entonces su restricción a (t_{k-1}, t_k) puede extenderse a una función continua f_k en $[t_{k-1}, t_k]$. Si f es seccionalmente monótona, su restricción a (t_{k-1}, t_k) puede extenderse a una función monótona f_k en $[t_{k-1}, t_k]$: Por ejemplo, si f es creciente en (t_{k-1}, t_k) , definimos

$$f_k(t_k) = \sup \{f(x) : x \in (t_{k-1}, t_k)\}$$

y

$$f_k(t_{k-1}) = \inf \{f(x) : x \in (t_{k-1}, t_k)\}$$

en ambos casos f_k es F-integrable en $[t_{k-1}, t_k]$ (teoremas 3.1.8 y 3.1.10) puesto que f coincide con f_k en $[t_{k-1}, t_k]$ excepto posiblemente en los extremos y el teorema 3.2.3, nos permite afirmar que f es F-integrable en $[t_{k-1}, t_k]$. Ahora por aditividad y un razonamiento inductivo muestran que f es F-integrable en $[a, b]$. //

En la teoría usual, el teorema de integración por partes, viene dado por la fórmula (para F_1 y F_2 , crecientes y con derivada continua)

$$(R-S) \int_a^b F_1 dF_2 + (R-S) \int_a^b F_2 dF_1 = F_1(b)F_2(b) - F_1(a)F_2(a)$$

y se cumple con la condición de que una u otra de las integrales exista, este teorema falla dramáticamente con $F_1 = F_2 = \delta_u$. Por supuesto falla también para integrales de Lebesgue-Stieltjes. La fórmula correcta para integrales de Lebesgue-Stieltjes fue dada por E. Hewitt en [2]. Su resultado puede ser presentado sin referencia a la teoría de Lebesgue-Stieltjes como sigue:

Teorema 3.2.5.- [INTEGRACION POR PARTES]. Supóngase que F_1 y F_2 son funciones crecientes sobre $[a, b]$ y definamos

$$F_1^*(t) = \frac{1}{2} [F_1(t^-) + F_1(t^+)] \text{ y } F_2^*(t) = \frac{1}{2} [F_2(t^-) + F_2(t^+)]$$

Para toda $t \in [a, b]$. Entonces

$$\int_a^b F_1^{\circ} dF_2 + \int_a^b F_2^{\circ} dF_1 = F_1(b)F_2(b) - F_1(a)F_2(a) \quad (5)$$

donde $F_1(b^+) = F_1(b)$, $F_1(a^-) = F_1(a)$, etc.

Demostración. - Ambas integrales en (5) existen (por ser funciones monótonas). Para una $\epsilon > 0$, existe una partición

$$P = \{a=t_0 < t_1 < \dots < t_n=b\}$$

tal que

$$S_{F_1}^{\circ}(F_2^{\circ}, P) = I_{F_1}^{\circ}(F_2^{\circ}, P) < \epsilon$$

haciendo un desarrollo algebraico a partir de las definiciones tenemos que

$$S_{F_2}^{\circ}(F_1^{\circ}, P) + I_{F_1}^{\circ}(F_2^{\circ}, P) = F_1(b)F_2(b) - F_1(a)F_2(a) \quad (6)$$

y también

$$S_{F_1}^{\circ}(F_2^{\circ}, P) + I_{F_1}^{\circ}(F_1^{\circ}, P) = F_1(b)F_2(b) - F_1(a)F_2(a) \quad (7)$$

se sigue de (6) que

$$\begin{aligned} \int_a^b F_1^{\circ} dF_2 + \int_a^b F_2^{\circ} dF_1 &\leq S_{F_2}^{\circ}(F_1^{\circ}, P) + S_{F_1}^{\circ}(F_2^{\circ}, P) \\ &< S_{F_2}^{\circ}(F_1^{\circ}, P) + I_{F_1}^{\circ}(F_2^{\circ}, P) + \epsilon \\ &= F_1(b)F_2(b) - F_1(a)F_2(a) + \epsilon \end{aligned}$$

y de (7) obtenemos

$$\int_a^b F_1^{\circ} dF_2 + \int_a^b F_2^{\circ} dF_1 > F_1(b)F_2(b) - F_1(a)F_2(a) - \epsilon$$

como ϵ es arbitrario tenemos la validez de (5)

Después de haber notado algunas de las ventajas que nos da el tratamiento generalizado de la integral pasaremos a comparar las integrales.

El criterio de integrabilidad de Riemann-Stieltjes implica el criterio usual de la integrabilidad de Darboux-Stieltjes; estos criterios no son equivalentes en general, pero son equivalentes si F es una función continua.

Teorema 3.2.6.- Si $F \in D(f)$ en $[a,b]$, entonces f es F -integrable y las integrales coinciden

Demostración. Para cualquier partición P ,

$$\begin{aligned} I_F(f, P) &= \sum_{k=1}^n m(f, [t_{k-1}, t_k]) \cdot [F(t_k) - F(t_k^-) + F(t_k^-) - F(t_{k-1}^+)] \\ &\quad + F(t_{k-1}^+) - F(t_{k-1})] \\ &< \sum_{k=1}^n f(t_k) [F(t_k) - F(t_k^-)] + \sum_{k=1}^n m(f, (t_{k-1}, t_k)) \cdot [F(t_k^-) - F(t_{k-1}^+)] \\ &\quad + \sum_{k=1}^n f(t_{k-1}) [F(t_{k-1}^+) - F(t_{k-1})] \end{aligned}$$

si sumamos la primer y tercer sumatorias obtenemos

$$\begin{aligned}
& \sum_{k=1}^n f(t_k) [F(t_k) - F(t_k^-)] + \sum_{k=0}^{n-1} f(t_k) [F(t_k^+) - F(t_k)] \\
&= f(t_n) [F(t_n) - F(t_n^-)] + \sum_{k=1}^{n-1} f(t_k) [F(t_k^+) - F(t_k^-)] \\
&\quad + f(t_0) [F(t_0^+) - F(t_0)] \\
&= \sum_{k=0}^n f(t_k) [F(t_k^+) - F(t_k^-)] = J_F(f, P)
\end{aligned}$$

con estas observaciones y recordando las definiciones de $I_F^*(f, P)$ nos muestran que $I_F(f, P) \leq I_F^*(f, P)$. De la misma forma tenemos $S_F(f, P) \geq S_F^*(f, P)$ y también

$$S_F^*(f, P) - I_F^*(f, P) \leq S_F(f, P) - I_F(f, P) \quad (8)$$

si $\epsilon > 0$, la teoría clásica muestra que existe una partición P tal que $S_F(f, P) - I_F(f, P) < \epsilon$, por (8) tenemos también que $S_F^*(f, P) - I_F^*(f, P) < \epsilon$ y así f es F -integrable.

Para ver la igualdad de las integrales, obsérvese que

$$(D-S) \int_a^b f dF \leq S_F(f, P) < I_F(f, P) + \epsilon \leq I_F^*(f, P) + \epsilon \leq \int_a^b f dF + \epsilon$$

y de manera análoga

$$(D-S) \int_a^b f dF > \int_a^b f dF - \epsilon //$$

Definición. 3.2.1.- La F-norma de una partición P es

$$F|P| = \max \{F(t_k) - F(t_{k-1}) : k=1,2,\dots,n\}$$

ya que F es una función creciente, podemos reestablecer el lema A2. En el apéndice.

Lema 3.2.1.- Si $\delta > 0$, existe una partición P tal que $F|P| < \delta$.

Teorema 3.2.7.- Una función acotada f sobre [a,b] es F-integrable, si y solo si, para cada $\epsilon > 0$, existe $\delta > 0$ tal que

$$F|P| < \delta \text{ implica } S_F^*(f,P) - I_F^*(f,P) < \epsilon \quad (9)$$

para todas las particiones P de [a,b].

Demostración. Necesidad: Supongamos que f es F-integrable sobre [a,b]. Sea $\epsilon > 0$, seleccionemos una partición de [a,b]

$$P_1 = \{a = u_0 < u_1 < \dots < u_j = b\}$$

tal que

$$S_F^*(f,P_1) - I_F^*(f,P_1) < \epsilon/2 \quad (10)$$

puesto que f es acotada, existe B > 0 tal que $|f(x)| \leq B$ para toda $x \in [a,b]$. Sea $\delta = \epsilon/(8jB)$; j es el número de intervalos contenidos por P_1 .

Para verificar (9), consideremos cualquier partición

$$P_2 = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$$

con $F|P_2| < \delta$. Sea $Q = P_1 \cup P_2$. Si Q tiene un elemento más que P_2 , entonces tal como en la demostración del lema 3.1.1. nos lleva a

$$I_F^\circ(f, Q) - I_F^\circ(f, P_2) \leq B F|P| - (-B) F|P| = 2B F|P|$$

puesto que Q tiene a lo más j elementos que no están en P_2 , un argumento de inducción nos muestra que

$$I_F^\circ(f, Q) - I_F^\circ(f, P_2) \leq 2jB \cdot F|P| < 2jB \delta = \epsilon/4$$

por el lema 3.1.1. tenemos $I_F^\circ(f, P_1) \leq I_F^\circ(f, Q)$ y también

$$I_F^\circ(f, P) - I_F^\circ(f, P_2) < \epsilon/4$$

análogamente

$$S_F^\circ(f, P_1) - I_F^\circ(f, P_2) < \epsilon/4$$

y también

$$S_F^\circ(f, P_2) - I_F^\circ(f, P_2) < S_F^\circ(f, P_1) - I_F^\circ(f, P_1) + \frac{\epsilon}{2}$$

y en vista de (10)

$S_F^\circ(f, P) - I_F^\circ(f, P) < \epsilon$ con lo que se verifica (9).

Suficiencia. Si la condición $\epsilon - \delta$ se cumple, entonces para $\epsilon > 0$ (9) nos da una partición P (lema 3.2.1) tal que $S_F^\circ(f, P) - I_F^\circ(f, P) < \epsilon$ para toda $\epsilon > 0$ por lo que f es F -integrable. //

A continuación se da una definición para la integral generalizada de Riemann-Stieltjes

Definición 3.2.2.- Sea f una función acotada sobre $[a,b]$ y sea

$$P = \{a=t_0 < t_1 < \dots < t_n=b\}$$

una suma de Riemann-Stieltjes generalizada de f asociada con P y F es una suma de la forma

$$R_F^*(f, P) = J_F(f, P) + \sum_{k=1}^n f(x_k) [F(t_k^-) - F(t_{k-1}^+)]$$

donde $x_k \in (t_{k-1}, t_k)$ para $k=1, 2, \dots, n$. La función es Riemann-Stieltjes generalizada-integrable sobre $[a,b]$, si existe $r \in \mathbb{R}$ con la siguiente propiedad. Para cada $\epsilon > 0$, existe $\delta > 0$ tal que

$$|R_F^*(f, P) - r| < \epsilon$$

para cada suma de Riemann-Stieltjes generalizada $R_F^*(f, P)$ con una partición P con $F|P| < \delta$, llamamos a r la integral de Riemann-Stieltjes generalizada y temporalmente escribiremos

$$(R-S-G) \int_a^b f dF$$

Teorema 3.2.8.- Una función f acotada en $[a,b]$ es F -integrable si y sólo si, es Riemann-Stieltjes generalizada integrable, en tal caso las integrales son iguales

Demostración. Necesidad. Sea f , F -integrable, sean $\epsilon > 0$ y $\delta > 0$ tal que se verifica (9) en el teorema 3.2.7. Tenemos que para toda suma de Riemann-Stieltjes generalizada

$$R_F^*(f, P) = J_F(f, P) + \sum_{k=1}^n f(x_k) [F(t_k^-) - F(t_{k-1}^+)]$$

asociada con una partición P con $F|P| < \delta$ se cumple

$$I_F^*(f, P) \leq R_F^*(f, P) \leq S_F^*(f, P)$$

y como

$$S_F^*(f, P) < I_F^*(f, P) + \epsilon \leq I_F^*(f) + \epsilon = \int_a^b f dF + \epsilon$$

y también

$$I_F^*(f, P) > S_F^*(f, P) + \epsilon \geq S_F^*(f) - \epsilon = \int_a^b f dF - \epsilon$$

por lo que

$$|R_F^*(f, g) - \int_a^b f dF| < \epsilon$$

f es Riemann-Stieltjes Generalizada-Integrable y

$$(R-S-G) \int_a^b f dF = \int_a^b f dF.$$

Suficiencia. Sea f-Riemann-Stieltjes Generalizada-Integrable y sea r como en la definición 3.2.2. Considérese $\epsilon > 0$ y sea $\delta > 0$ (como en la misma definición). Por el lema 3.2.1, existe una partición $P = \{a=t_0 < t_1 < \dots < t_n=b\}$ con $F|P| < \delta$. Seleccionemos, para cada $k=1, 2, \dots, n$, $x_k \in (t_{k-1}, t_k)$ de tal forma que $f(x_k) < m(f, (t_{k-1}, t_k)) + \epsilon$. Para ésta elección de los x_k , la suma generalizada satisface

$$R_F^*(f, P) \leq I_F^*(f, P) + \epsilon [F(b) - F(a)]$$

y también

$$|R_F^*(f, P) - r| < \epsilon;$$

por lo que $I_F^*(f) \geq I_F^*(f, P) > r - \epsilon - \epsilon [F(b) - F(a)]$. Se sigue que $I_F^*(f) \geq r$ y en forma semejante $S_F^*(f) \leq r$. De aquí que $I_F^*(f) = S_F^*(f) = r$ y así f es F-integrable y

$$\int_a^b f dF = (R-S-G) \int_a^b f dF$$

3.3 INTEGRALES IMPROPIAS DE RIEMANN-STIELTJES

Definición 3.3.1.- Supóngase que f es F -integrable sobre cada intervalo $[a, b]$ en \mathbb{R} . Hacemos la siguiente definición cuando los límites existan:

$$\int_0^{\infty} f dF = \lim_{b \rightarrow \infty} \int_0^b f dF; \quad \int_{-\infty}^0 f dF = \lim_{a \rightarrow -\infty} \int_a^0 f dF$$

si ambos límites existen y sus sumas no tienen la forma $\infty + (-\infty)$, definimos

$$\int_{-\infty}^{\infty} f dF = \int_{-\infty}^0 f dF + \int_0^{\infty} f dF$$

si esta suma es finita, decimos que f es F -integrable en \mathbb{R}

Teorema 3.3.1.- Si f es F -integrable sobre cada intervalo $[a, b]$ y si $f(x) \geq 0$ para toda $x \in \mathbb{R}$, entonces f , es F -integrable sobre \mathbb{R} o bien $\int_{-\infty}^{\infty} f dF = +\infty$.

Demostración.- Sea $h(b) = \int_0^b f dF$ para $b > 0$, nótese que si $0 < b < b'$

$$h(b') = \int_0^{b'} f dF = \int_0^b f dF + \int_b^{b'} f dF$$

por lo que $h(b) \leq h(b')$ y así h es una función creciente lo que implica que $\lim_{b \rightarrow \infty} h(b)$ exista y

$b \rightarrow \infty$

$$\lim_{b \rightarrow \infty} h(b) = \inf \{h(b) : b \in (0, \infty)\}$$

el caso $\lim_{a \rightarrow \infty} \int_a^{\infty} f dF$ es análogo.

Teorema 3.3.2.- Sea (u_n) una sucesión de puntos distintos en R y sea (c_n) una sucesión de números positivos tales que $\sum c_n < \infty$. (Usando la notación del ejemplo 3.2.1). Sea $F = \sum_{n=1}^{\infty} c_n \delta_{u_n}$. Entonces toda función acotada f sobre R es F -integrable y

$$\int_{-\infty}^{\infty} f dF = \sum_{n=1}^{\infty} c_n f(u_n)$$

Demostración.- Tenemos por el teorema 3.2.1 y la definición que

$$\begin{aligned} \int_{-\infty}^{\infty} f dF &= \lim_{b \rightarrow +\infty} \int_{-b}^b f dF = \lim_{b \rightarrow +\infty} \sum_{n=1}^{\infty} c_n f(u_n) \\ &= \sum_{n=1}^{\infty} c_n f(u_n) \end{aligned}$$

Teorema 3.3.3.- Supóngase que F es diferenciable sobre R y que F' es continuo sobre R . Si f es continua sobre R entonces

$$\int_{-\infty}^{\infty} f dF = \int_{-\infty}^{\infty} f(x) F'(x) dx$$

Demostración .- Por el teorema 3.1.9 las integrales coinciden en $[-b, b]$, así entonces

$$\int_{-b}^b f(x) dF(x) = \int_{-b}^b f(x) F'(x) dx$$

por lo que

$$\lim_{b \rightarrow \infty} \int_{-b}^b f(x) dF(x) = \lim_{b \rightarrow \infty} \int_{-b}^b f(x) F'(x) dx$$

esto es

$$\int_{-\infty}^{\infty} f(x) dF(x) = \int_{-\infty}^{\infty} f(x) F'(x) dx.$$

siempre que los límites existan.//

CAPITULO 4.

ALGUNAS APLICACIONES DE LA INTEGRAL DE RIEMANN-STIELTJES.

4.1.- UNA APLICACION EN PROBABILIDAD-LA DEFINICION DE ESPERANZA MATEMATICA.

Con el concepto de Integral de Riemann-Stieltjes desarrollado en el capítulo 3, podemos definir de forma unificada el concepto de Esperanza Matemática para variables aleatorias con funciones de distribución discretas, o continuas. Para ello recordemos algunos conceptos fundamentales de la teoría de la Probabilidad.

Definición 4.1.1.- Un *espacio de probabilidad* es una terna (Ω, \mathcal{a}, P) , donde Ω es un conjunto no vacío, \mathcal{a} es una σ -álgebra de subconjuntos de Ω y P es una función real definida sobre \mathcal{a} con las siguientes propiedades

- i) $P(A) \geq 0$ para todo elemento $A \in \mathcal{a}$
- ii) $P(\Omega) = 1$
- iii) Si $A_1, A_2, \dots, A_n, \dots$ es una sucesión de elementos de \mathcal{a} , mutuamente ajenos, entonces

$$P\left(\bigcup_{j=1}^{\infty} A_j\right) = \sum_{j=1}^{\infty} P(A_j).$$

Definición 4.1.2.- Sea (Ω, \mathcal{a}, p) un espacio de probabilidad y X , una función real definitiva sobre Ω . Diremos que X es una *variable aleatoria real* (v.a), si para todo par de números reales a, b , con $a < b$ los conjuntos $\{a < X < b\}$, $\{a \leq X < b\}$, $\{a < X \leq b\}$, $\{a \leq X \leq b\}$ pertenecen a la σ -álgebra \mathcal{a} de los sucesos sobre Ω .

Diremos que la v.a. X es *discreta*, si toma a lo más un número infinito numerable de valores. En este caso, la función $f(x)=P[X=x]$ es llamada la función de densidad de la v.a. X . Diremos que X es una v.a. *continua* si $P(X=x)=0 \forall x \in \mathbb{R}$.

Diremos que x es una v.a. *absolutamente continua* (a,c) , si existe una función real *f* integrable, que cumple

- i) $f(x) \geq 0$ para toda x , real
- ii) $\int_{\mathbb{R}} f(x) dx = 1$
- iii) $P(a \leq x \leq b) = \int_a^b f(x) dx$

una tal función f , es llamada la función de densidad de la v.a. X .

Una v.a. continua no necesariamente es absolutamente continua, aunque es claro que si X es a.c. entonces es continua.

Definición 4.1.3.- La función de distribución (f.d) de una v.a. X definida sobre (Ω, \mathcal{B}, p) , es la función real F definida para todo número real x por medio de

$$F(x) = P(X \leq x) = \sum_{x' \leq x} f(x') \quad \text{si } X \text{ es discreta} \quad (1)$$

$$F(x) = P(X \leq x) = \int_{-\infty}^x f(x') dx' \quad \text{si } X \text{ es a.c.} \quad (2)$$

donde f es la función de densidad de X . Si X es v.a. discreta, entonces

$$f(x) = F(x) - F(x^-) \quad \forall x \in \mathbb{R} \quad (3)$$

X es v.a. continua si, y solo si, su f.d. es continua y en ese caso $P(a \leq X \leq b) = P(a \leq X < b) = P(a < X \leq b) = P(a < X < b) = F(b) - F(a)$ y si X es v.a.a.c., entonces en los puntos de continuidad de f

$$f(x) = \frac{d}{dx} F(x) \quad \forall x \in \mathbb{R} \quad (4)$$

Hemos definido las funciones de distribución en términos de variables aleatorias. Pueden definirse directamente

Definición 4.1.4.- Una función de distribución (f, d) , es cualquier función F que satisface las siguientes propiedades

- (i) $0 \leq F(x) \leq 1 \quad \forall x \in \mathbb{R}$,
- (ii) F es una función creciente,
- (iii) $F(-\infty) = 0$ y $F(+\infty) = 1$,
- (iv) $F(x^+) = F(x) \quad \forall x$.

Nótese que si $F(x)$ es definida como en (2) para la función de densidad f, es una f.d. continua que satisface las propiedades (i)-(iv) de la definición anterior. Decimos que tal f.d. tiene densidad f y aquellas funciones que tienen densidades son llamadas f.d. absolutamente continuas.

Retomando la notación del ejemplo 3.2.1, a una función como $\delta_u(t)$ se le llama *distribución puntual concentrada* en u, f.d. que es de este tipo se dice "degenerada"; en caso contrario "no degenerada".

Todas las propiedades de las funciones crecientes dadas en el apéndice, son válidas para una f.d. En particular, sea $\{u_j\}$ el conjunto numerable de puntos de salto de F y c_j la medida del salto en u_j . Entonces

$$F(u_j) - F(u_j^-) = c_j$$

ya que F es continua por la derecha. Consideremos la función

$$F_d(x) = \sum_j c_j \delta_{u_j}(x) \quad (5)$$

(notación del ejemplo 3.2.1) la cual representa la suma de todos los saltos de F en $(-\infty, x)$. Esta es creciente, continua por la derecha con

$$F_d(-\infty) = 0 \quad \text{y} \quad F_d(+\infty) = \sum_j c_j \leq 1$$

F_d se llama la parte de saltos de F ,

Teorema 4.1.1. Sea $F_c(x) = F(x) - F_d(x)$, entonces $F_c(x)$ es positiva, creciente y continua.

Demostración. - Sea $x < x'$, entonces tenemos

$$\begin{aligned} F_d(x') - F_d(x) &= \sum_{x < u_j \leq x'} c_j = \sum_{x < u_j \leq x'} [F(u_j) - F(u_j^-)] \\ &\leq F(x') - F(x) \end{aligned}$$

de donde sigue que ambas F_d y F_c son crecientes, y si ponemos $x = -\infty$, vemos que $F_d \leq F$ y así F_c es positiva. F_d es continua por la derecha puesto que cada $\delta_{u_j^-}$ lo es y la serie que define F_d converge uniformemente en x ; el mismo argumento nos demuestra que

$$F_d(x) - F_d(x^-) = \begin{cases} c_j & \text{si } x = u_j \\ 0 & \text{de otra forma} \end{cases}$$

ahora, esta evaluación se cumple también si cambiamos F_d por F de acuerdo a la definición de u_j y c_j por lo que obtenemos que para cada x

$$F_c(x) - F_c(x^-) = F(x) - F(x^-) - [F_d(x) - F_d(x^-)] = 0$$

esto demuestra que F_c es continua por la izquierda; puesto que lo es también por la derecha, al ser la diferencia de dos funciones tales, tenemos que F_c es continua.

Teorema 4.1.2.- Sea F una f.d. Supóngase que existe una función continua G_c y una función G_d de la forma

$$G_d(x) = \sum_j c_j' \delta_{u_j}'(x)$$

[donde $\{u_j\}$ es un conjunto numerable de números reales y $\sum_j |c_j'| < \infty$], tal que

$$F = G_c + G_d$$

entonces

$$G_c = F_c, \quad G_d = F_d$$

donde F_c y F_d son como antes.

Demostración. Si $F_d \neq G_d$, entonces los conjuntos $\{u_j\}$ y $\{u_j'\}$ no son idénticos, o podemos remarcar los u_j' de forma que $u_j' = u_j$ para toda j pero $a_j' \neq a_j$ para alguna j . En cualquiera de los casos tenemos para al menos una j , y $\bar{u} = u_j$ o u_j' :

**ESTA TESIS NO DEBE
SALIR DE LA BIBLIOTECA**

$$[F_d(\bar{u}) - F_d(\bar{u}^-)] - [G_d(\bar{u}) - G_d(\bar{u}^-)] \neq 0$$

puesto que $F_c - G_c = G_d - F_d$ esto último implica que

$$F_c(\bar{u}) - G_c(\bar{u}) - [F_c(\bar{u}^-) - G_c(\bar{u}^-)] \neq 0$$

en contradicción con el hecho de que $F_c - G_c$ es una función continua. Por lo tanto $F_d = G_d$ y en consecuencia $F_c = G_c$.

Definición 4.1.5.- Una f.d. que puede representarse en la forma

$$F = \sum_j c_j \delta_{u_j}$$

donde $\{u_j\}$ es un conjunto numerable de números reales, $c_j > 0$ y $\sum_j c_j = 1$, se llama f.d. discreta.

Supóngase que $F_c \neq 0$, $F_d \neq 0$ en el teorema 4.1.1, entonces podemos hacer $p = F_d(\infty)$ de modo que $0 < p < 1$,

$$F_1 = \frac{1}{p} F_d, \quad F_2 = \frac{1}{1-p} F_c,$$

y escribir

$$F = pF_1 + (1-p)F_2 \quad (6)$$

ahora F_1 es una f.d discreta y F_2 es una f.d continua, y F es dada por una combinación convexa de ellas. Si $F_c \neq 0$, entonces F es discreta y hacemos $p \equiv 1$, $F_1 \equiv F$, $F_2 \equiv 0$; si $F_d \neq 0$, entonces F es continua y hacemos $p \equiv 0$, $F_1 \equiv 0$, $F_2 \equiv F$; por lo que (6) es válida en cualquiera de los casos extremos.

Con lo anterior podemos resumir los resultados de los dos teoremas anteriores en el siguiente.

Teorema 4.1.3.- Toda f.d. puede escribirse como la combinación convexa de una discreta y una continua. Tal descomposición es única.

Definición 4.1.6.- Sea X una v.a. discreta con valores $u_1, u_2, \dots, u_n, \dots$ en R y con función de densidad $f(x)$. Siempre que $\sum_j x_j c_j$ converja la *Esperanza Matemática* de X se define como

$$\begin{aligned}
 EX &= x_1 f(x_1) + \dots + x_n f(x_n) + \dots = \sum_{j=1}^{\infty} x_j f(x_j) \\
 &= \sum_{j=1}^{\infty} x_j c_j \\
 &= \int_{-\infty}^{\infty} x dF(x) \qquad (7)
 \end{aligned}$$

donde $c_j = F(x_j) - F(x_j^-) = f(x_j)$ de acuerdo con la definición 4.1.3 y $F(x)$ es dada como en la definición 4.1.5 y la última integral de acuerdo al teorema 3.3.2.

Definición 4.1.7.- Si X es una v.a. absolutamente continua con función de densidad $f(x)$, siempre que $\int_{-\infty}^{\infty} x f(x) dx$ exista definimos la *Esperanza Matemática* de X como

$$EX = \int_{-\infty}^{\infty} x f(x) dx = \int_{-\infty}^{\infty} x dF(x) \qquad (8)$$

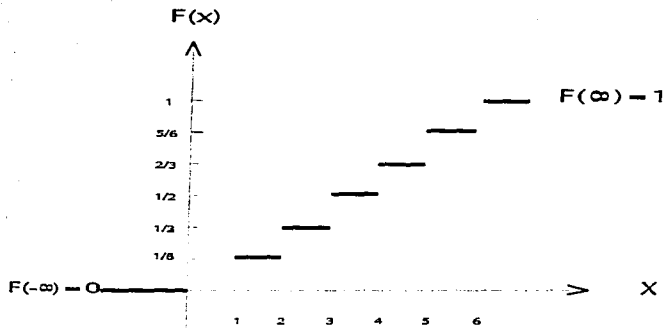
donde $F(x)$ es como en (4) de la definición 4.1.3 y la segunda igualdad se deduce del teorema 3.3.3.

Ejemplo 4.1.1.- Considérese el lanzamiento de un dado honesto y sea X la v.a que da el total de puntos obtenidos. La función de densidad es

$$f(x) = P[X=x] = \begin{cases} 1/6 & \text{si } x=1,2,\dots,6 \\ 0 & \text{de otra forma} \end{cases}$$

la función de Distribución $F(x)$ es

$$F(x) = P[X \leq x] = \sum_{t \leq x} f(t) = \begin{cases} 0 & \text{si } x < 1 \\ 1/6 & \text{si } 1 \leq x < 2 \\ 2/6 & \text{si } 2 \leq x < 3 \\ \cdot & \cdot \\ \cdot & \cdot \\ \cdot & \cdot \\ 1 & \text{si } 6 \leq x \end{cases}$$



Consideremos un juego donde la ganancia es 2 si X es par y -1 si X es impar. La ganancia promedio es

$$\begin{aligned} E(G(x)) &= \int_{-\infty}^{\infty} G(x) dF(x) = \sum_1 G(x_i) [F(x_i^+) - F(x_i^-)] \\ &= \sum_1 G(x_i) f(x_i) = 1/2 \end{aligned}$$

Ejemplo 4.1.2.- Consideremos en los siguientes casos el intervalo $[0,1]$ y sea $f(x)$ dado por

$$f(x) = \begin{cases} 0 & \text{si } x \in \mathbb{Q} \\ 1 & \text{si } x \notin \mathbb{Q} \end{cases}$$

(a) Si la función distribución es dada por

$$F_1(x) = \begin{cases} 0 & \text{si } x < 1/2 \\ 1 & \text{si } x \geq 1/2 \end{cases}$$

entonces f es F_1 -integrable, así que

$$E(f(x)) = \int_0^1 f dF_1 = f(1/2) = 0$$

(b) Si la función distribución es dada por

$$F_2(x) = \begin{cases} 0 & \text{si } x < 1/\sqrt{2} \\ 1 & \text{si } x \geq 1/\sqrt{2} \end{cases}$$

f es F_2 -integrable

$$E(f(x)) = \int_0^1 f dF_2 = f(1/\sqrt{2}) = 1$$

(c) Sea $\{u_n, n \geq 1\}$ cualquier numeración del conjunto de todos los racionales en $[0,1]$.

Si la función distribución es dada por

$$F_3(x) = \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{2^n} \delta_{u_n}(x) \quad \text{donde} \quad \delta_{u_n}(x) = \begin{cases} 0 & \text{si } x < u_n \\ 1 & \text{si } x \geq u_n \end{cases}$$

f es F_3 -integrable y

$$E(f(\mathbf{x})) = \int_0^1 f(\mathbf{x}) dF_3(\mathbf{x}) = \sum_n \frac{1}{2^n} f(\mathbf{u}_n) = 0$$

4.2. FLUJO DE FLUIDOS VISCOSOS

4.2.1.- *FLUJO LAMINAR*.- Cuando un fluido viscoso fluye a través de un tubo cilíndrico no lo hace con todo el fluido a la misma velocidad; el fluido más cercano a las paredes del tubo sufre más fricción con las paredes y apenas se mueve del todo; cuando el fluido es cercano al eje central del tubo, se mueve más rápidamente. La velocidad del fluido se incrementa constantemente cuando se incrementa la distancia a la pared. Debido a la simetría circular, el efecto es de "tubos" concéntricos de fluido que se deslizan uno sobre el otro. Este efecto es llamado *Fluido Laminar*; cada lámina o capa de fluido se mueve a su propia velocidad. Diferentes láminas se mueven a diferente velocidad.

La forma exacta de cómo se da el fluido laminar fue encontrada por J.L.M. Poiseville (1797-1869) quien estudiaba la presión sanguínea, la cual logra medir por primera vez, quería conocer cuanta sangre fluye a través de un vaso sanguíneo en un tiempo dado. De esta información y del análisis de muestras sanguíneas, uno puede decir cuanto oxígeno y nutrientes están siendo distribuidos a las células servidas por ese vaso. El conocimiento del flujo sanguíneo es una parte básica del entendimiento del cuerpo como sistema físico.

El resultado de Poiseville acerca del flujo de fluidos viscosos tiene otras aplicaciones como el flujo de aire en la tráquea, el aceite es un oleoducto, el agua es un sistema de tuberías, los granos arrojados por un tubo en la bodega de un barco, etc. Las suposiciones involucradas en el resultado le hacen más aplicable a algunos problemas que a otros, pero nos da una buena primera aproximación de todos ellos. Otro uso importante de la ley de Poiseville es medir la viscosidad relativa de los fluidos.

4.2.2. LEY DE POISEVILLE.- Poiseville descubrió y después otros dedujeron teóricamente, que la velocidad de las partículas de un fluido a una distancia de r centímetros fuera del eje central del tubo es

$$V(r) = \frac{P}{4KL} (R^2 - r^2) \quad (\text{cm/seg}) \quad (1)$$

donde

- R= radio del tubo en cm. (Así $0 \leq r \leq R$)
- L= longitud del tubo (cm.)
- P= cambio de presión $P_1 - P_2$ a lo largo del tubo, (dina/cm²)
- K= coeficiente de viscosidad

(ver figura 1) (recordemos que presión es fuerza por unidad de área). Uno puede probar que la presión decrece constantemente [como función lineal] cuando el fluido se mueve a lo largo del tubo. Esto es la diferencia de presión final vs inicial que entra en la ecuación. La unidad cgs de viscosidad, el poise es llamado después Poiseville

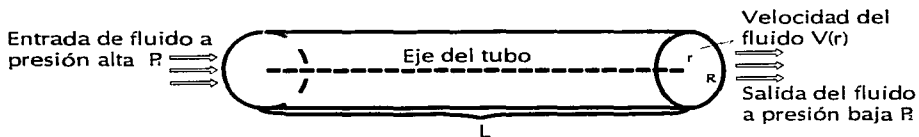


Figura 1.

Las diversas hipótesis que deben ser ciertas para que (1) sea válido son:

- i) No debe haber *turbulencia* en el fluido, esto significa que no hay remolinos; las partículas del fluido se mueven en líneas rectas a lo largo del tubo.
- ii) La velocidad del flujo v se supone que depende únicamente de r ; v no cambia cuando el fluido se mueve a lo largo del tubo, ni cambia con el tiempo.
- iii) El fluido es *conservativo*, i.e, ni se crea, ni se pierde en el tubo. El fluido no escapa fuera a través de las paredes ni hay tubos alimentadores que pongan fluido dentro o fuera.
- iv) El fluido es *Incomprensible*, i.e, hecho de partículas que no pueden ser trozadas o aprisionadas unas a otras (por las fuerzas presentes).
- v) El tubo es horizontal y los efectos de la gravedad son ignorados. Para un tubo vertical (1) se transforma en

$$V(r) = \frac{P + g \rho L}{4KL} (R^2 - r^2) \quad (2)$$

donde $g=980 \text{ cm/sec}^2$ es la constante de gravitación y ρ es la densidad del fluido, i.e, su masa por unidad de volumen. Para tubos inclinados estas velocidades horizontales y verticales deben sumarse vectorialmente. Por simplicidad usaremos (1)

- vi) El tubo es un cilindro circular recto con dimensiones constantes L y R
- vii) Hay mucha fricción en la pared, que el fluido no se mueve del todo (nótese que $r=R$ nos lleva a $V(r)=0$)
- viii) El fluido no es un *Fluido Ideal* (las partículas friccionan entre sí)

Estas suposiciones son satisfechas en varios grados en las aplicaciones mencionadas antes, es propenso que ocurran efectos turbulentos en tubos de diámetro grande. Esto limita el uso de la ley en el estudio de tuberías, oleoductos, tolvas de granos, etc., las dimensiones de los vasos sanguíneos cambian un poco, la sangre es bombeada por el corazón por lo que el flujo no está en estado uniforme, oxígeno y nutrientes abandonan la sangre por ósmosis a través de las paredes del tubo, así el fluido es aproximadamente conservado únicamente.

Desechando éstos y otros defectos prácticos, la Ley de Poiseville es una simplificación válida del flujo de fluidos viscosos. En cierto sentido, esto es lo verdadero de la Ley; $v(r)$ es cero en las paredes del tubo y se incrementa constantemente cuando r decrece y se acerca al centro del tubo. Esto tiene bases teóricas sólidas y bien entendidas. Podemos realmente calcular con ella, y en el laboratorio las condiciones supuestas pueden ser hechas realidad, dando un camino práctico para medir el coeficiente de viscosidad k para cualquier fluido, propiedad fundamental del fluido e importante en el diseño y trabajo de Ingeniería.

4.2.3.- VELOCIDAD Y CANTIDAD DE FLUJO.

Queremos usar la Ley de Poiseville para calcular el flujo total a través de un tubo de radio R . El flujo F es el volumen total de fluido que pasa a través del tubo cada segundo en unidades de cm^3/seg .

Consideremos primero (figura 2) cualquier pedazo pequeño típico de área de sección transversal del tubo, consistiendo de ΔA cm^2 localizados r cm fuera del centro. ¿Cuánto fluido dejará el tubo a través de este pequeño bocado de área en un segundo?. El fluido se mueve $v(r)$ cm en un segundo; así una cantidad de fluido $v(r)$ cm de largo, de sección transversal constante ΔA cm^2 fluirá fuera del tubo a través de ΔA en un segundo. Esta cantidad tiene volumen $v(r) \cdot (\Delta A)$.

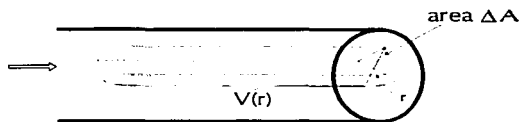


Figura 2.

Así el fluido ΔA a una razón constante de $v(r) \cdot \Delta A$ cm^3/seg .

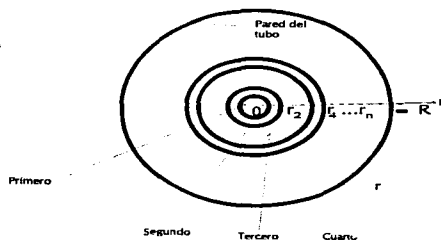
En la sección transversal del tubo circular de radio R , la velocidad $v(r)$ dada por la Ley de Poiseville es la misma en todos los puntos localizados r cm del centro. Si consideramos anillos concéntricos de área (figura 3), la velocidad del fluido

será aproximadamente constante en cada anillo. Podemos usar el resultado previo para calcular el *flujo total* a través de cada anillo, la suma de flujos anillo por anillo será el flujo total a través del tubo, el cual queremos encontrar.

Para identificar claramente estos anillos, partiremos el intervalo ($0 \leq r \leq R$) en n piezas usando puntos de partición

$$0 = r_0 < r_1 < \dots < r_n = R$$

(no necesariamente igual espaciados), la primera, segunda, ..., regiones son elegidas como se muestra en el dibujo.



Para $k=1, 2, \dots, n$, la k -ésima región es un anillo con radio interior y exterior r_{k-1} y r_k y así tiene área

$$\pi(r_k)^2 - \pi(r_{k-1})^2$$

si tomamos n grande y los r_k cercanos unos a otros, la velocidad del fluido que fluye a través de cualquier región será casi constante, aunque diferente de anillo a anillo. ¿Que valor se aproximará a la velocidad constante en el k -ésimo anillo? Tomando cualquier punto en ese anillo, digamos uno que está t_k unidades fuera del centro con $r_{k-1} \leq t_k \leq r_k$. Entonces $v(t_k)$ es una

velocidad para el k-ésimo anillo y lo visto antes nos dice que el flujo a través del k-ésimo anillo $=v(t_k) \cdot [\pi r_k^2 - \pi r_{k-1}^2]$.

Llamaremos a t_k un punto de evaluación para el k-ésimo subintervalo $[r_{k-1}, r_k]$.

Así el flujo total a través de todos los n anillos es

$$F \approx \sum_{k=1}^n v(t_k) \cdot [\pi r_k^2 - \pi r_{k-1}^2] \quad (3)$$

Escribimos "aproximadamente" en vez de igual porque hemos reemplazado los varios valores de $v(r)$ en el k-ésimo anillo por el valor simple $v(t_k)$. En efecto, tenemos una familia de aproximaciones de F en la ecuación (3) para cualquier partición P y cualquier elección de los puntos de evaluación. Como tomamos valores mayores de n y r_k 's y t_k 's más cercanamente espaciados, la teoría de integración nos dice que tales sumas se aproximan a un valor límite, la integral Riemann-Stieltjes de v respecto a A.

Sea la longitud de k-ésimo subintervalo

$$r_k - r_{k-1} \quad \text{y} \quad A(r) = \pi r^2$$

si se incrementa n, r_k y r_{k-1} se aproximan uno al otro y su diferencia $\Delta r_k \rightarrow 0$. Así si $n \rightarrow \infty$, $\Delta r_k \rightarrow 0$, por lo que tenemos que F es una suma de Riemann-Stieltjes

$$F = \int_0^R v(r) dA(r)$$

$$= \int_0^R \frac{P}{4KL} (R^2 - r^2) d(\pi r^2)$$

y por el teorema 3.1.9 al ser $A(r)$ continua en $[0, R]$ con $A'(r) = 2\pi r$ continua en $[0, R]$ tenemos

$$F = \int_0^R \frac{P}{4KL} (R^2 - r^2) 2\pi r dr = \frac{R^4 P}{8KL}.$$

APENDICE SOBRE FUNCIONES CRECIENTES

Definición. A-1. Sea f una función real definida en un conjunto S de \mathbb{R} . Si para cualquier par de números x, y de S con $x < y$ se tiene que $f(x) \leq f(y)$, se dice que f es creciente en S .

Teorema A-1. Si f es una función creciente en $[a, b]$, entonces los límites laterales $f(x_0^+)$ y $f(x_0^-)$ existen para cada $x_0 \in (a, b)$ y se verifica que

$$f(x_0^-) \leq f(x_0) \leq f(x_0^+). \quad (1)$$

En los extremos se tiene

$$f(a) \leq f(a^+) \quad \text{y} \quad f(b^-) \leq f(b).$$

Demostración. Consideremos $A = \{f(x) : a < x < x_0\}$. Dado que f es creciente, $f(x_0)$ es cota superior de A . Si tomamos $c = \text{SUP } A$, entonces $c \leq f(x_0)$. Existen elementos $f(x)$ en A para los cuales, dada $\varepsilon > 0$, se cumple $c - \varepsilon < f(x) \leq c$. Tomemos $x_1 < x_0$ de forma que $c - \varepsilon < f(x_1) < c$. Ahora para $\varepsilon > 0$ y $\delta = x_0 - x_1 > 0$. Si $x_0 - x < x_0$ entonces $|f(c) - c| < \varepsilon$, por lo que $f(x_0^-)$ existe y es igual a c . La demostración de la existencia de $f(x_0^+)$ y de que $f(x_0^+) \geq f(x_0)$ es análoga. El mismo argumento sirve para los extremos del intervalo. //

Definición A-2. - f tiene una discontinuidad de salto en x_0 si existen $f(x_0^-)$ y $f(x_0^+)$ pero $f(x_0^-) \neq f(x_0^+)$.

Teorema A-2.- El único tipo posible de discontinuidades de una función creciente es de saltos.

Demostración.- Es inmediato de (1) en el teorema A-1 y la existencia de los límites laterales.//

Teorema A-2.- El conjunto de discontinuidades de una función f creciente es numerable.

Demostración: Sea S el conjunto $\{x : x \text{ es un punto de salto}\}$. Para cada $x \in S$, considérese el intervalo abierto $I_x = (f(x^-), f(x^+))$. Si $x' \in S$, y $x < x'$, digamos, entonces hay un punto \bar{x} tal que $x < \bar{x} < x'$. Por lo que, debido a la monotonía de f tenemos

$$f(x^+) \leq f(\bar{x}) \leq f(x'^-)$$

por lo que se sigue que I_x y $I_{x'}$ son ajenos.

Así que podemos asociar a S en el dominio de f , una cierta colección de intervalos abiertos ajenos en el rango de f . Ahora cualquiera de las colecciones es necesariamente numerable puesto que cada intervalo contiene números racionales, así que la colección de intervalos está en correspondencia uno a uno con cierto subconjunto de racionales como, este numerable, se deduce que el conjunto de discontinuidades es también numerable.//

Usaremos la notación $S_n \uparrow s$ con el significado de que (S_n) es una sucesión no decreciente que converge a s y $S_n \downarrow s$, si (S_n) es una sucesión no creciente con límite s .

Lema A.1.- Sea g una función creciente sobre $[a, b]$.

i) Si $u_n \uparrow u$, entonces $g(u_n^-) \uparrow g(u^-)$.

ii) Si $u_n \downarrow u$, entonces $g(u_n^+) \downarrow g(u^+)$.

Demostración.- Probaremos ii). Supóngase que $u_n \downarrow u$, sea $\varepsilon > 0$; aquí $u \in [a, b]$. Existe $v > u$ tal que $v \in [a, b]$ y $g(v) < g(u^+) + \varepsilon$. Seleccionemos N natural, tal que $n > N$ implica $u_n < v$. Entonces

$$n > N \text{ implica } g(u_n^+) \leq g(v) < g(u^+) + \varepsilon.$$

Puesto que $g(u_n^+) \geq g(u^+)$ para todo n , concluimos que $g(u_n^+) \downarrow g(u^+)$; lo que prueba ii). //

Lema A.2.- Si g es una función creciente sobre $[a, b]$ y si $\varepsilon > 0$, existe una partición $P = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$ tal que

$$g(t_k^-) - g(t_{k-1}^+) < \varepsilon \quad \text{para } k = 1, 2, \dots, n \quad (2)$$

Demostración.- Primero mostraremos que existe una partición $Q = \{a = s_0 < s_1 < \dots < s_m = b\}$ tal que $g(u^+) - g(u^-) < \varepsilon$ para $u \in Q$. es suficiente mostrar que $S = \{s \in (a, b) : g(s^+) - g(s^-) \geq \varepsilon\}$ es finito. Seleccionemos $r \in \mathbb{N}$ tal que $r\varepsilon > g(b) - g(a)$. Si S tiene más de $r-1$ elementos, podemos seleccionar

$$a < t_1 < t_2 \dots < t_r < b$$

de modo que $g(t_k^+) - g(t_k^-) \geq \varepsilon$ para $k = 1, 2, \dots, r$, pero esto implica

$$g(b)-g(a) \geq g(t_r^+) - g(t_1^-) \geq \sum_{k=1}^r [g(t_k^+) - g(t_k^-)] \geq r\varepsilon > g(b) - g(a)$$

Así, S es finito y Q puede ser seleccionado satisfaciendo (2).

Ahora mostraremos que existe δ tal que

$$u, v \in [s_{j-1}, s_j], u < v, v - u < \delta \text{ implica } g(v^-) - g(u^+) < \varepsilon \quad (3)$$

Si (3) falla, entonces para alguna j existen sucesiones (u_n) y (v_n) en $[s_{j-1}, s_j]$ donde $u_n < v_n, v_n - u_n < 1/n$ y $g(u_n^-) - g(u_n^+) \geq \varepsilon$.

Pasando a subsucesiones, podemos suponer que (u_n) y (v_n) son monótonas. Para obtener una contradicción, consideremos cuatro casos.

Si $u_n \uparrow u$, y $v_n \uparrow u$, entonces por el lema A.1 tenemos $g(u_n^-) - g(u^-)$ y $g(v_n^-) - g(u^-)$, de aquí que $[g(v_n^-) - g(u_n^-)] \rightarrow 0$. Puesto que $g(v_n^-) - g(u_n^-) \geq g(v_n^-) - g(u_n^+) \geq \varepsilon$ para toda n , tenemos una contradicción

Si $u_n \downarrow u$, y $v_n \downarrow u$, entonces el lema A.1 nos muestra que

$g(u_n^+) - g(u^+)$ y $g(v_n^+) - g(u^+)$, y así $[g(v_n^+) - g(u_n^+)] \rightarrow 0$, por otro lado tenemos para cada n

$$g(v_n^+) - g(u_n^+) \geq g(v_n^-) - g(u_n^+) \geq \varepsilon$$

que es una contradicción.

El caso $u_n \downarrow u$, y $v_n \uparrow u$ es imposible puesto que implicaría $u \leq u_n \leq v_n < u$.

Finalmente, supóngase $u_n \uparrow u$, y $v_n \downarrow u$, entonces $s_{j-1} < u < s_j$; de otra manera (u_n) o (v_n) sería una sucesión constante y podríamos apelar a uno de los casos iniciales. Esta vez el lema A-1 muestra que $g(u_n^-) \rightarrow g(u^-)$ y $g(v_n^+) \rightarrow g(u^+)$, y por tanto

$$g(u^+) - g(u^-) = \lim_{n \rightarrow \infty} [g(v_n^+) - g(u_n^-)] \geq \liminf [g(v_n^-) - g(u_n^+)] \geq \varepsilon;$$

puesto que $u \in Q$, esto contradice (2), con lo que se prueba (3).

Agregando puntos a la partición Q podemos obtener una partición $P = \{a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b\}$ tal que QSP y tal que $t_k - t_{k-1} < \delta$ para toda $k=1, 2, \dots, 2n$.

Si k está en $\{1, 2, \dots, n\}$ entonces ambos t_{k-1} y t_k pertenecen a algún $[s_{j-1}, s_j]$ y así por (3) tenemos $g(t_k^-) - g(t_{k-1}^+) < \varepsilon$. //

BIBLIOGRAFIA

- [1].- K. Ross: Another approach to Riemann-Stieltjes Integral
American Mathematical Monthly oct. 1980 P.P.660-662.
- [2].- E. Hewitt. Integration by parts or Stieltjes Integral
American Mathematical Monthly vol. 67 (1960) P.P.419-423.
- [3].- C. Edwards. The Historical Development of the Calculus
Springer Verlag, 1979.
- [4].- T. Hawkins: Lebesgue theory of Integration. Chelsea
Publishing Company, 1975.
- [5].- G. Birkhoff: A Source Book in Classical Analysis Harvard.
U.P., 1973.
- [6].- T. Apostol: Mathematical Analysis. 2^{ed}. Adisson-Wesley,
1981.
- [7].- K. Ross. Elementary Analysis: The theory of Calculus
Springer Verlag, 1980.
- [8].- W. Rudin: Principles of Mathematical analysis. Mc Graw-
Hill, 1976.
- [9].- G.Y. Shilov: Mathematical Analysis. Pergamón Student.
- [10].- R. Griego: Conceptos de Probabilidad. Colección
Matemática Superior.
- [11].- M. Loeve: Probability theory 1. 4th Ed. Springer Verlag,
1963.
- [12].- K.L. Chung: A Course in Probability theory. Ac. Press,
1977.

- [13].- Hoel, Port. Stone: Introduction to Probability theory. Houghton Mifflin, 1971.
- [14].- Ahlfors. Complex Analysis Mc. Graw-Hill, 1953.
- [15].- P.Tuchinsky. Viscous Fluid Flow and the integral calculus. UMAP. Unit 210.
- [16].- G. Shilov. B.Gurevich, Integral, Measure and Derivative: A UNIFIED APPROACH. Dover.
- [17].- R. Silverman Complex Analysis with Applications Prentice Hall.