

Нормировка μ и ν на \mathbb{R}^n

$$\mu(\mathbb{R}^n) = \nu(\mathbb{R}^n) = 1$$

Пусть μ и ν — меры на \mathbb{R}^n и \mathbb{R}^m соответственно. Тогда μ и ν называются мерами на \mathbb{R}^n и \mathbb{R}^m соответственно. Пусть μ и ν — меры на \mathbb{R}^n и \mathbb{R}^m соответственно. Тогда μ и ν называются мерами на \mathbb{R}^n и \mathbb{R}^m соответственно. Пусть μ и ν — меры на \mathbb{R}^n и \mathbb{R}^m соответственно. Тогда μ и ν называются мерами на \mathbb{R}^n и \mathbb{R}^m соответственно.

Пусть μ и ν — меры на \mathbb{R}^n и \mathbb{R}^m соответственно. Тогда μ и ν называются мерами на \mathbb{R}^n и \mathbb{R}^m соответственно.

$$\begin{aligned} \int_{\mathbb{R}^n} \int_{\mathbb{R}^m} f(x, y) \, \mu(dx) \, \nu(dy) &= \int_{\mathbb{R}^n} \left[\int_{\mathbb{R}^m} f(x, y) \, \nu(dy) \right] \mu(dx) \\ &= \int_{\mathbb{R}^n} \left[\int_{\mathbb{R}^m} f(x, y) \, \nu(dy) \right] \mu(dx) \\ &= \int_{\mathbb{R}^n} \left[\int_{\mathbb{R}^m} f(x, y) \, \nu(dy) \right] \mu(dx) \\ &= \int_{\mathbb{R}^n} \left[\int_{\mathbb{R}^m} f(x, y) \, \nu(dy) \right] \mu(dx) \end{aligned}$$

□