à celle dans $\mathfrak{R}^N$ (prise au sens de Lebesgue); soit $a(t \mid x, Y)$ défini pour $t \in \mathsf{P}$ comme auparavant (on a $t \in \mathfrak{R}^N$ pour un N).

La suite $\{\Theta_N\}$ est croissante et sa limite est presque égale à $\Theta = \Sigma\, U^N . (N)$ $(N = 1, 2, \ldots)$. Pour chaque N fixe, l'expression sous le signe *lim* dans la relation à démontrer est égale à

$$E(x, Y) + \int_{\Theta_N} a(t \mid x, Y)\,\mathrm{d}t,$$

ce qui tend (pour $N \to \infty$) vers

$$E(x, Y) + \int_{\Theta} a(t \mid x, Y)\,\mathrm{d}t,$$

ce qui n'est que $K_U\, A(u \mid x, Y)\,\mathrm{d}t$, c. q. f. d.

Si l'on reprend la démonstration du premier théorème, on voit que

$$K_U\, A(u + 0 \mid x, Y)\,\mathrm{d}u = K_U\, A(u \mid x, Y)\,\mathrm{d}u$$

ce qui donne le

Corollaire: *La fonction* $A(t \mid x, Y)$ $(t \in \mathfrak{R},\ x \in R,\ Y \subset R$ *mesurable*), *réelle et bornée étant mesurable en* $(t \mid x)$, *complètement additive en* Y *et telle que* $A(t + 0 \mid x, Y)$ *existe, les conditions*

$$A(t + 0 \mid x, R) = 0,$$
$$A(t + 0 \mid x, Y) \geqq 0 \quad \textit{pour} \quad x \in R - Y$$

sont nécessaires et suffisantes pour que

$$K_U\, A(u \mid x, R)\,\mathrm{d}u = 1,$$
$$K_U\, A(u \mid x, Y)\,\mathrm{d}u \geqq 0.$$

*

O jistém problému S. Bernsteina a A. Kolmogorova.

(Obsah předchozího článku.)

Jest řešit rovnici (Ch) tak, aby platily vztahy (O).[1] Ukazuji, že existuje právě jedno řešení rovnice (Ch) s podmínkami (c) a (d), a nalézám nutné a dostatečné podmínky (pro A), aby platilo (O) (viz poslední korolár).