Asumiendo las funciones $f_{x1}(x)$ y $f_{x2}(x)$ como v.a.c. exponenciales de parámetro λ , y luego reemplazando por $\frac{1}{u}$ al resolver la integral.

$$f(y) = \int_{-\infty}^{+\infty} f_{x1}(x) f_{x2}(y - x) dx$$

$$= \int_{0}^{y} \lambda e^{-\lambda x} \lambda e^{-\lambda(y - x)} dx$$

$$= \int_{0}^{y} \lambda^{2} e^{-\lambda x} e^{\lambda x} e^{-\lambda y} dx$$

$$= \int_{0}^{y} \lambda^{2} e^{-\lambda y} dx$$

$$= \lambda^{2} e^{-\lambda y} x \Big|_{0}^{y}$$

$$= \lambda^{2} e^{-\lambda y} y - 0$$

$$= \lambda^{2} y e^{-\lambda y}$$

$$= (\frac{1}{\mu})^{2} y e^{-\frac{1}{\mu} y}$$

$$= \frac{y}{\mu^{2}} e^{-y/\mu}$$