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

$$
\begin{aligned}
f(y) &= \int_{-\infty}^{+\infty} f_{x1}(x) f_{x2}(y-x)\,dx \\
&= \int_0^y \lambda e^{-\lambda x} \lambda e^{-\lambda(y-x)}\,dx \\
&= \int_0^y \lambda^2 e^{-\lambda x} e^{\lambda x} e^{-\lambda y}\,dx \\
&= \int_0^y \lambda^2 e^{-\lambda y}\,dx \\
&= \lambda^2 e^{-\lambda y} x \Big|_0^y \\
&= \lambda^2 e^{-\lambda y} y - 0 \\
&= \lambda^2 y e^{-\lambda y} \\
&= (\frac{1}{\mu})^2 y e^{-\frac{1}{\mu} y} \\
&= \frac{y}{\mu^2} e^{-y/\mu}
\end{aligned}
$$