

# Función de densidad

**Definición 1 (Función de densidad).** Sea  $X$  una v.a. continua en un espacio de probabilidad  $(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$ ,  $f_X: \mathbb{R} \rightarrow [0, 1] \in \mathcal{L}^1(m)$  es la función de densidad de  $X$

$$\iff \forall B \in \mathcal{B}(\mathbb{R}) : \mathbb{P}(X \in B) = \int_B f_X(x) \, dx.$$