

Variable aleatoria continua

Definición 1 (Variable aleatoria continua). Sea X una variable aleatoria en un espacio de probabilidad $(\Omega, \Sigma, \mathbb{P})$, X es (absolutamente) continua

$\iff \mu_X$ es absolutamente continua respecto a la medida de Lebesgue

donde $\mu_X : \mathcal{B}(\mathbb{R}) \longrightarrow [0, 1]$ viene dada por $\forall B \in \mathcal{B}(\mathbb{R}) : \mu_X(B) = \mathbb{P}(X \in B)$.