

Función de densidad

Definición 1 (Función de densidad). Sea X una v.a. 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

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