

Fórmula de la esperanza

Corolario 1. Sea $X \in \mathcal{L}^1(\mathbb{P})$ una variable aleatoria $\implies \mathbb{E}[X] = \int_{\mathbb{R}} t \, d\mu_X(t)$.

Demostración: Tomamos $g(t) = t$ en la Prop-esperanza-fn/Proposición 1. ■