

Soit  $X$  une variable aléatoire absolument continue admettant pour densité  $f$ . Soit  $(a, b) \in \mathbb{R}^2$  avec  $a > 0$ .

Démontrer que  $Y = aX + b$  est une variable aléatoire absolument continue et exprimer sa densité en fonction de  $f$ .



On utilise le théorème d'identification. La densité  $f_Y$  de  $Y$  est l'unique fonction telle que pour toute fonction  $h$  continue bornée, on ait

$$\mathbb{E}(h(Y)) = \int_{\mathbb{R}} h(y) f_Y(y) dy.$$

Or, étant donné  $h$ , on a

$$\begin{aligned} \mathbb{E}(h(Y)) &= \mathbb{E}(h(aX + b)) \\ &= \int_{\mathbb{R}} h(ax + b) f_X(x) dx \quad (\text{par le théorème de transfert}) \\ &= \int_{\mathbb{R}} h(y) f_X\left(\frac{y-b}{a}\right) \frac{1}{a} dy \quad (\text{par changement de variable } y = ax + b) \end{aligned}$$

d'où son identification

$$f_Y(y) = \frac{1}{a} f_X\left(\frac{y-b}{a}\right).$$