

Ex 1 - Densité et transformation affine

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

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