

Pour qu'une fonction  $f_x(u)$  soit une densité de probabilité, il faut et il suffit :

\*  $f_x(u) \geq 0 \quad \forall u \in \mathbb{R}$

\*  $f_x(u)$  soit intégrable  $\int_{-\infty}^{+\infty} f_x(u) du = 1$



$P(X \in ]-\infty, +\infty[) = 1$

$$F_x(t) = \int_{-\infty}^t f_x(u) du$$

$$f_x(t) = \frac{dF_x(t)}{dt}$$