

Teorema 5.1. (Ω, \mathcal{A}, p) sia uno spazio di probabilità ed $X, Y : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ due variabili aleatorie elementari. Sia $\alpha \in \mathbb{R}$. Allora

$$\begin{aligned} M(\alpha X) &= \alpha MX \\ M(X + Y) &= MX + MY \end{aligned}$$

Dimostrazione. Scriviamo dappertutto \sum_a invece di $\sum_{a \in \mathbb{R}}$.

CONTINUARE DA SOLA.