

Lad p være en sandsynlighedstæthed på intervallet $[-1, 1]$. Gør rede for, at hvis X er en stokastisk variabel med tæthed p , så får $Y = X^2$ tæthed

$$\frac{1}{2\sqrt{y}} (p(\sqrt{y}) + p(-\sqrt{y}))$$

på enhedsintervallet.