

Af (1) følger det umiddelbart at $p(x) = F'(x) \geq 0$. Af (2) følger at

$$\int_{-\infty}^{+\infty} p(x) dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{-n}^n p(x) dx = \lim_{n \rightarrow \infty} (F(n) - F(-n)) = 1.$$

Almindelig bemærkning: Funktionen F er den til p hørende *fordelingsfunktion*, jvf. næste afsnit.