window.alert('Minha Primeira Mensagem!.')

Vai exibir Minha primeira mensagem!. na tela e você somente terá a opção de apertar ok.

window.confirm('Está gostando de JavaScript?')

Vai exibir Está gostando de estudar JavaScript? e você terá a opção de confirmar como o comando disse, clicando em sim ou não.

window.prompt('Qual é o seu nome?')

Vai exibir Qual é o seu nome? na tela e você terá de digitar o que quiser, mas melhor digitar seu nome como a pergunta está pedindo.