

Annexe D

Définition générale d'une variable aléatoire

Si (Ω, C, Pr) désigne un espace probabilisé, et (E, ε) un espace probabilisable, un **élément aléatoire**, défini sur (Ω, C, Pr) et à valeurs dans (E, ε) , est une application mesurable de (Ω, C) dans (E, ε) . Cet élément est appelé :

- variable aléatoire réelle si l'espace (E, ε) est l'espace (\mathbb{R}, B) , dans lequel B est la tribu de Borel de \mathbb{R} ;
- variable aléatoire complexe si l'espace (E, ε) est l'espace (\mathbb{C}, C) ;
- variable aléatoire vectorielle ou vecteur aléatoire, de dimension n , si l'espace (E, ε) est l'espace (\mathbb{R}^n, B^n) .

2 ANNEXE D. DÉFINITION GÉNÉRALE D'UNE VARIABLE ALÉATOIRE

Bibliographie