

Chapitre 2

Variables aléatoires

Définition 2.1 - variable aléatoire

Soit (Ω, \mathcal{F}) un espace mesurable. On appelle *vecteur aléatoire* sur Ω une application de Ω dans \mathbb{R}^n . Pour $n = 1$, on parle de *variable aléatoire*.

Remarque 2.2 - notation associée

Pour $A \in \mathbb{R}^n$, on notera $\{X \in A\}$ l'évènement :

$$\{\omega \in \Omega, X(\omega) \in A\}$$