

Norma de una variable aleatoria

Definición 1 (Norma p -ésima). Sea $X: \Omega \longrightarrow \mathbb{R}$ una variable aleatoria y $p \in [1, \infty)$,

$$\|X\|_p \text{ es la norma } p\text{-ésima de } X \iff \|X\|_p = (\mathbb{E}[|X|^p])^{1/p}.$$

Referenciado en

- Desigualdad-holder
- Desigualdad-minkowski
- Desigualdad-holder-generalizada