

Définition

Soit $m \in \mathbb{R}$ et $\sigma \in \mathbb{R}_+^*$.

La loi de probabilité d'une variable aléatoire continue X est la **loi normale** ou **loi de Laplace-Gauss** de paramètres m et σ , notée $\mathcal{N}(m, \sigma)$, si la densité de probabilité f est définie par :

$$f(x) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{1}{2}\left(\frac{x-m}{\sigma}\right)^2}.$$