

Définition

On appelle **variance de X** le nombre réel positif, noté $V(X)$, défini par :

$$V(X) = E(X^2) - [E(X)]^2 = \int_{-\infty}^{+\infty} x^2 f(x) dx - [E(X)]^2.$$

L'**écart type de X** , noté $\sigma(X)$, est la racine carrée de la variance :

$$\sigma(X) = \sqrt{V(X)}.$$