

Théorème 1

Soit X une variable aléatoire et n variables aléatoires X_1, X_2, \dots, X_n de même loi de probabilité que celle de X .

Si on pose $S_n = X_1 + X_2 + \dots + X_n$ et $Y_n = \frac{S_n}{n}$, alors :

pour tout $\varepsilon > 0$ $\lim_{n \rightarrow +\infty} P(|Y_n - E(X)| < \varepsilon) = 1.$