

Kapitel 4 – formel definition af stokastisk variabel, s. 77

Definition

En stokastisk variabel X er en afbildning fra udfaldsrummet Ω over i de reelle tal:

$$X : \Omega \rightarrow E$$

Hvor E er en delmængde af de reelle tal \mathbb{R} . For et element ω i sandsynlighedsrummet Ω betegnes $X(\omega)$ som *værdien* af den stokastiske variabel X . E er så mængden af alle mulige værdier.

En hændelse A er en delmængde af udfaldsrummet $A \subseteq \Omega$.