

Consideremos un espacio probabilístico $(\Omega, \mathcal{F}, P[\cdot])$. Una **variable aleatoria** (a partir de ahora **v.a.**) no es más que un número real asociado al resultado de un experimento aleatorio. Se trata, por tanto, de una función real con dominio en la σ -álgebra del espacio probabilístico, $X : \Omega \rightarrow R$.

Sin embargo, una v.a. debe verificar además que, para cada $x \in R$, el suceso $\{\omega \in \Omega : X(\omega) \leq x\}$ pertenezca a la σ -álgebra considerada. \square