

Propriété 1 : Soit X une variable aléatoire qui suit la loi normale centrée réduite $\mathcal{N}(0 ; 1)$.

Soit α un réel de l'intervalle $]0 ; 1[$. Il existe un unique réel positif u_α tel que

$$p(-u_\alpha \leq X \leq u_\alpha) = 1 - \alpha.$$

