

Théorème 32

Pour $\lambda=1$ le calcul effectué pour démontrer le th. 30

permet d'écrire $V(X+Y) = V(X) + 2 \text{Cov}(X, Y) + V(Y)$

Si de plus X et Y sont indépendantes alors on sait

que $\text{Cov}(X, Y) = 0$ et on a bien $V(X+Y) = V(X) + V(Y)$