

Sur l'œuvre de Paul Lévy

C'est un paradoxe que nous possédions aussi peu de textes sur l'œuvre de Paul Lévy (15 septembre 1886–15 décembre 1971); il y a bien sûr l'introduction exemplaire de Michel Loève, au début du premier volume de la revue *Annals of Probability* – citons aussi l'Hommage à Paul Lévy (Astérisque 1987). Ici, à la suite d'une journée à la mémoire de Paul Lévy organisée le 15 décembre 2011 au Laboratoire de Probabilités et Modèles Aléatoires, nous avons choisi de reprendre deux textes d'une grande concision et profondeur, qui représentent l'esprit et la somme de chacun des deux livres de Paul Lévy: *Théorie de l'addition des variables aléatoires* d'une part, et *Processus stochastiques et mouvement brownien* d'autre part. Trois autres textes, également lus le 15 décembre 2011, nous ont semblé un peu loin du thème central pour être reproduits ici.

Nous remercions très chaleureusement les 5 conférenciers, qui se sont donné beaucoup de mal pour refléter l'essentiel de l'œuvre de Paul Lévy. Les deux textes retenus essaient de résumer deux livres importants de Paul Lévy. Je voudrais aussi inviter le lecteur à lire :

- Sur certains processus stochastiques homogènes (*Compositio Math.*, 1939),
- Trois théorèmes sur le mouvement brownien (pour l'Avancement des Sciences à la Libération) où Paul Lévy, avec des techniques élémentaires, nous montre comment en tirer quelques gemmes.

Remerciements : Cette journée en hommage à Paul Lévy a été rendue possible notamment grâce au soutien financier du LPMA.

Marc Yor