Jean-Jacques LILTI

Professeur agrégé des Universités



Présentation

> Laboratoire de recherche : CREM UMR CNRS 6211

> Responsable pédagogique :

- Master 1 Finance
- Master 1 Finance
- Master 2 Finance

Recherche et entreprise

Rayonnement scientifique

- Expert AERES

Thèmes de recherche

Modèles à facteurs et rentabilités d’actifs

Asset management

Gestion des Risques

Efficience des marchés

Finance et RSE

Activités pédagogiques

Enseignements principaux

- Asset Management
- Ingénierie financière
- Gestion des risques financiers
- Théorie financière
- Méthodes quantitatives

Publications

Jean-Jacques Lilti, Julien Lachuer. Do sustainability reports make sense for asset selection?. Management international = International management = Gestión internacional, 2021, 25 (2), pp.88-106.

Julien Lachuer, Jean-Jacques Lilti. Performance globale et discours responsable des PDG : analyse sur 132 entreprises du SP 500. Revue management

Julien Lachuer, Jean-Jacques Lilti. La Responsabilité Sociale de l'Entreprise (RSE) : quel impact sur la prime de risque des actions ?. La Revue des Sciences de Gestion, 2019, N°299-300 (299),

Dhoha Trabelsi, Saqib Aziz, Jean-Jacques Lilti. A behavioral perspective on corporate dividend policy: evidence from France. Corporate Governance: The international journal of business in society, 2019, 19 (1), pp.102-119.

Saqib Aziz, Jean-Jacques Lilti. Bank Deregulation, Consolidation and Stability: Evidence on U.S. M

Saqib Aziz, Jean-Jacques Lilti, Khalid Elbadraoui. Bank Acquisitiveness and Bailouts: Evidence on European Banks during the 2008 Financial Crisis. Bankers Markets

Saqib Aziz, Michael Dowling, Jean-Jacques Lilti. Bank Acquisitiveness and Financial Crisis Vulnerability. Bankers Markets

Saqib Aziz, Jean-Jacques Lilti. Bank Deregulation, Consolidation and Stability: Evidence on U.S. M

Jean-Jacques Lilti, Gulten Mero. What Drives Stock Return Commonalities? Evidence from France and the USA Using a Cross – Sectional Approach. Bankers Markets

Jean-Jacques Lilti, Emmanuelle Fromont. Le bêta est mort et le trône reste vacant : quelques évolutions des modèles de rentabilités d'actifs. F. Moraux, L. Bironneau. Recherches et innovations en sciences de gestion, Presses universitaires de Rennes, pp.61-74, 2013, Des sociétés.

Jean-Jacques Lilti, Khalid Elbadraoui. The long-run operating performance of canadian convertible debt issuers : trends and explanatory factors. International Journal of Business, 2012, 17 (3), pp.299-324.

Jean-Jacques Lilti, Khalid Elbadraoui, Bouchra M'Zali, Homayoon Shalchian. On the performance of socially responsible investing : further evidence. Bankers Markets

Khalid Elbadraoui, Jean-Jacques Lilti, Bouchra M'Zali. An analysis of risk changes surrounding French convertible bond offerings. Bankers Markets

Jean-Jacques Lilti. L'évolution des modèles d'évaluation d'actifs. Presses Universitaires de Toulouse. Mélanges aux Pr Pierre Spiteri, Presses Universitaires de Toulouse, pp.15, 2008.

Khalid Elbadraoui, Jean-Jacques Lilti, Bouchra M'Zali. La Performance Opérationnelle à Long Terme des Émetteurs d'ObligationsConvertibles en France : Évaluation et Facteurs Explicatifs. 2e Conférence Euro-Africaine en Finance et Economie, 2008, Carthage, Tunisie. 28 p.

Jean-Jacques Lilti, Khalid Elbadraoui, Bouchra M'Zali. La Performance Opérationnelle à Long Terme des Entreprises Françaises Émettrices d'Obligations Convertibles. Finance Contrôle Stratégie, 2008, pp.25.

Jean-Jacques Lilti, Yannick Gouzerh. Capital humain et CAPM conditionnel: une comparaison internationale des rentabilités d'actions. Banque

Jean-Jacques Lilti, Anthony Miloudi. Les modèles à facteurs : les variables fondamentales aux facteurs statistiques. Sciences de Gestion et Pratiques managériales, Economica, pp.481-491, 2002, Gestion.

Jean-Jacques Lilti, Anthony Miloudi. Les modèles à facteurs : les variables fondamentales aux facteurs statistiques. Banque

Direction de thèses

Three essays on stock market integration in emerging markets
Doctorant : BENDOU Najlae
Date de soutenance : 05/12/2022

A better factor model based on the investigation of anomalies in european stock market
Doctorant : XUE Ke
Date de soutenance : 16/11/2020

Performance financière et choix d'actifs responsables : une analyse du marché américain
Doctorant : LACHUER Julien
Date de soutenance : 30/11/2017

Exploring Risk Factors on Chinese A-Share Stock Market – in the Frame of Fama-French Factor Model
Doctorant : JIAO Wenting
Date de soutenance : 21/09/2017

Three essays on mergers and acquisitions and bank stability
Doctorant : AZIZ Saqib
Date de soutenance : 29/04/2016

Performance evalutation of portfolio insurance strategies
Doctorant : TAWIL Dima
Date de soutenance : 10/11/2015

Les apports des modèles factoriels dans la problématique de tarification de l'ARCEP : l'exemple de France Telecom
Doctorant : MOUTOU Albert
Date de soutenance : 08/12/2011

Modèles à facteurs latents et rentabilités des actifs financiers
Doctorant : MERO Gulten
Date de soutenance : 29/11/2010