

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

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

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.

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

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. 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.

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 evaluation 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 Gulden

Date de soutenance : 29/11/2010