



## Jean-Jacques LILTI

### Professeur agrégé des Universités

> **Laboratoire de recherche** : CREM UMR CNRS 6211

> **Responsable pédagogique** :

- [Master Finance, parcours Audit, Gestion des Risques et des Actifs](#)

> **Recherche et Entreprise** :

#### Rayonnement scientifique

- Expert AERES

#### Thèmes de recherche

Modèles à facteurs et rentabilités d'actifs

Asset management

Gestion des Risques

Efficiency des marchés

#### Activités pédagogiques

##### Enseignements principaux

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

#### Activités de recherche

##### Articles dans des revues classées

---

AZIZ S., LILTI J.J., **Bank Deregulation, Consolidation and Stability: Evidence on U.S. M&A centric activity**, *Finance*, 2017, Vol.38, p.85-128. [Cat 2 CNRS]

AZIZ S., LILTI J.J., EL BADRAOUI K., **Bank Acquisitiveness and Bailouts: Evidence on European Banks during the 2008 Financial Crisis**, *Bankers, Markets and Investors*, juillet-Août 2017, n°149. [Cat 4 CNRS]

LILTI J.J., AZIZ S., DOWLING M. (2016), **Bank Acquisitiveness and Financial Crisis Vulnerability**, *Bankers, Markets & Investors*, *RB Edition*, juillet-août 2016, n°143, 26-44 [CNRS 4 / HCERES C]

LILTI J.J., MERO G. (2013), **What drives stock return commonalities ? Evidence from France and US using a cross-sectional approach**, *Bankers Markets Investors*, 2013 septembre, n°126, 5-13, [CNRS 4 / HCERES C]

##### Ouvrages/Chapitres d'ouvrages

---

FROMONT E., LILTI J.J., **Le bêta est mort et le trône reste vacant : quelques évolutions des modèles de rentabilités d'actifs**, *In "Recherches et innovations en sciences de gestion"*, ouvrage collectif sous la direction scientifique de Franck MORAUX et Laurent BIRONNEAU, Presses Universitaires de Rennes, pp 61-74, 2013

##### Communications/Colloques

---

##### Autres productions

---

##### Direction de thèses

---

Performance financière et choix d'actifs responsables : une analyse du marché américain  
Docteurant : LACHUER Julien  
Date : 30/11/2017 Direction de thèse : [LILTI Jean-Jacques](#)

Exploring Risk Factors on Chinese A-Share Stock Market - in the Frame of Fama-French Factor Model  
Docteurant : JIAO Wenting  
Date : 21/09/2017 Direction de thèse : [LILTI Jean-Jacques](#)

Three essays on mergers and acquisitions and bank stability  
Docteurant : AZIZ Saqib  
Date : 29/04/2016 Direction de thèse : [LILTI Jean-Jacques](#)

Performance evaluation of portfolio insurance strategies  
Docteurant : TAWIL Dima  
Date : 10/11/2015 Direction de thèse : [LILTI Jean-Jacques](#)

Les apports des modèles factoriels dans la problématique de tarification de l'ARCEP : l'exemple de France Telecom  
Docteurant : MOUTOU Albert  
Date : 08/12/2011 Direction de thèse : [LILTI Jean-Jacques](#)

Modèles à facteurs latents et rentabilités des actifs financiers  
Docteurant : MERO Gulden  
Date : 29/11/2010 Direction de thèse : [LILTI Jean-Jacques](#)