

Gulten MERO

Coordonnées professionnelles

THEMA – Université de Cergy-Pontoise

UFR Economie Gestion,

33 Boulevard du Port

95011 Cergy-Pontoise

Tel : +33 (0)1 34 25 23 00

Mobile : +33 (0)6 30 01 33 70

E-mail : gulten.mero@u-cergy.fr

SITUATION ACTUELLE / ANTERIEURE

Sept. 2011- 2009-2011	Maître de Conférences à l'Université de Cergy-Pontoise, THEMA Attachée Temporaire d'Enseignement et de Recherche (ATER) à l'Université d'Evry-Val-d'Essone, UFR Economie – Gestion
2007-2011	Affiliée au laboratoire Finance-Assurance (LFA), CREST-INSEE
2006-2009	Allocataire de recherche à l'IGR-IAE de Rennes

FORMATION

2006-2010	Doctorat en Sciences de Gestion à l'IGR-IAE de Rennes Titre de la thèse : Modèles à facteurs latents et rentabilités des actifs financiers Direction : Gaëlle LE FOL, Université Paris IX-Dauphine, CEREG et CREST Jean-Jacques LILTI, IGR-IAE de Rennes, CREM UMR CNRS 6211 Thèse soutenue publiquement le 29 Novembre 2010 à l'IGR-IAE de Rennes Membres du jury : Jean-Paul Laurent (président du jury), Jacques Hamon (rapporteur), Patrick Roger (rapporteur), Franck Moraux (examinateur), Patrick Navatte (examinateur), Gaëlle Le Fol et Jean-Jacques Lilti Mention : Très honorable avec les félicitations du jury à l'unanimité
2005-2006	Master Recherche « Politique Financière et Finance de Marché », IGR-IAE de Rennes Mémoire: Modèles de rentabilités d'actions et évolution des méthodologies de test : une application sur le marché américain, major de promotion
2003-2005	Maitrise en Sciences de Gestion (option finance de marché), IGR-IAE de Rennes, major de promotion
2000-2003	Diplôme Supérieur Consulaire en Gestion et Commerce (Bac +3), Ecole de Gestion et Commerce (EGC)-Groupe FIM, Saint-Lô, major de promotion

THEMES DE RECHERCHE ET MOTS CLES

Gestion de portefeuille, marchés financiers, économétrie de la finance, microstructure des marchés financiers, analyse de données de panel, modèles à facteurs, risque de liquidité, volatilité stochastique, relation volatilité-volume.

PUBLICATIONS

- **Measuring the Liquidity Part of Volume**, avec S. Darolles et G. Le Fol, *Journal of Banking and Finance*, 50, 92-105, 2015.
- **What Drives Stock Return Commonalities: Evidence from France and US Using a Cross-Sectional Approach**, avec JJ. Lilti, *Bankers, Markets & Investors*, 126, 5-13, 2013
- **Hedge Fund Returns and Factor Models: A Cross-Sectional Approach**, avec S. Darolles, *Bankers, Markets & Investors*, 112, 34-53, 2011.
- **Financial Market Liquidity: Who is Acting Strategically?** avec S. Darolles et G. Le Fol, revise and resubmit, 2016.

ENSEIGNEMENTS

- Depuis 2011 **Université de Cergy-Pontoise**
- Gestion de Portefeuilles (M2, Cours et TD)
 - Marchés Financiers 1 – Actions et Obligations (M1, Cours)
 - Marchés Financiers 2 – Produits dérivés (M1 Cours)
 - Microstructure des marchés Financiers (M2, Cours)
- John von Neumann Institute of Vietnam National University – Ho Chi Minh City**
- Behavioral Finance (M1, Cours et TD)
- 2009-2011 **Université d'Evry Val d'Essonne**
- Gestion de Portefeuille (M1, TD), Modélisation Financière sur Excel (M1, Cours et TD), Introduction aux Théories Financières (L3, TD), Econométrie sur Excel (L3, TD).
- 2008-2009 **IGR-IAE de Rennes**
- Introduction to Empirical Finance and Factor Models (M2, Cours), Microstructure des Marchés Financiers (M1, TD), Analyse financière et Investissement (L3, TD)
- ENSAE – ParisTech**
- Econométrie de la Finance (3ème année, TD)

EXPERIENCES PROFESSIONNELLES

- Juin-Déc. 2006 **Stage, Société Générale Asset Management / Alternative Investment (SGAM/AI)**
Modélisation des risques des *Hedge Funds* et optimisation de portefeuille
- Mai-Juill. 2005 **Stage, Banque de France – Paris-Raspail**
Analyse financière et cotation d'entreprises

COMPETENCES LINGUISTIQUES ET INFORMATIQUES

- Langues** Français (bilingue), Anglais (courant), Italien (courant), Albanais (langue maternelle)
- Logiciels** Matlab, R, Mathematica, E-Views, Office, LaTeX, Reuters, Bloomberg