

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

## FORMATION

---

|           |   |
|-----------|---|
| 2006-2010 | <b>Doctorat en Sciences de Gestion</b> à l'IGR-IAE de Rennes<br><b>Titre de la thèse :</b> Modèles à facteurs latents et rentabilités des actifs financiers<br><b>Direction :</b> Gaëlle LE FOL, Université Paris IX-Dauphine, CEREG et CREST<br>Jean-Jacques LILTI, IGR-IAE de Rennes, CREM UMR CNRS 6211<br><b>Thèse soutenue publiquement</b> le 29 Novembre 2010 à l'IGR-IAE de Rennes<br><b>Membres du jury :</b> 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<br><b>Mention :</b> Très honorable avec les félicitations du jury à l'unanimité |
| 2005-2006 | Master Recherche « Politique Financière et Finance de Marché », IGR-IAE de Rennes<br>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