

AFFI 2007

Programme détaillé / Detailed program

Séminaire doctoral / Doctoral Colloquium

Mercredi/Wednesday - June. 27. 2007 - 10:00-13:00

Session 1						Session 2					
Salle/Room	CHAIRPERSON					Salle/Room	CHAIRPERSON				
Code	2	3	5	6	7	Code	8	10	11	12	13
<i>Auteur/Author</i>	Karfoul Hazem	Al Buraki Salam	Smaoui Aida	Ronsse Anne-Lise	Cadot Julien	<i>Auteur/Author</i>	Ngendahayo Eric	Croquet Mélanie	Subbotin Alexandre	Sellami Mezghanni Basma	Louizi Amir
<i>Titre/Title</i>	<i>L'intégration dynamique du risque opérationnel: Une approche par le concept « Seuil optimal de risque opérationnel »</i>	<i>L'influence du statut mutualiste et coopératif sur la gouvernance d'entreprise-cas du secteur financier.</i>	<i>Excès de confiance et optimisme des dirigeants: cas des firmes initiatrices d'une acquisition</i>	<i>Causes et impacts des changements de notation : le cas de l'offre publique sur les entreprises françaises cotées sur la période 1997-2005</i>	<i>L'asymétrie d'information entre l'entrepreneur et le banquier : le cas de l'installation en vitiviniculture</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Microcrédit et théorie financière : Une contribution à la compréhension des déterminants de la performance des institutions de microcredit</i>	<i>Analyse de l'applicabilité des conclusions des théories de compromis et de la théorie des préférences de financement hiérarchisées dans l'explication du comportement en matière de choix de financement des grandes entreprises belges non cotées</i>	<i>Turbulence of Financial Market, Financial Crises and Asset Allocation</i>	<i>Gouvernement d'entreprise, investissement dans les activités de recherche et développement et performance</i>	<i>La Bonne Gouvernance d'Entreprise et les Agences de Rating : le cas des entreprises françaises</i>
Commentateur/ Discussant	Franz Maurer	Jérôme Pouget	Christian Prat dit Hauret	Eric Lamarque	Olivier Brandouy	Commentateur/ Discussant	Sophie Brana	Isabelle Martinez	Joanne Hamet		Pedro Arbulu

Sessions parallèles / Parallel Sessions

Mercredi/Wednesday - June. 27. 2007 - 10:00-11:30

Session 1				Session 2			
Salle/Room : 200	Market Finance		CHAIRPERSON François QUITTARD-PINON	Salle/Room : 201	Gouvernance d'entreprise		CHAIRPERSON Isabelle MARTINEZ
Code	71	24	119	Code	47	55	88
<i>Auteur/Author</i>	Switzer Lorne & Huang Yanfen	Krainer Robert	Jurczenko Emmanuel & Maillet Bertrand & Yanou Ghislain	<i>Auteur/Author</i>	Francoeur Claude & Labelle Réal & Martinez Isabelle	Khiari Wided & Karaa Adel & Omri Abdelwahed	Allemand Isabelle
<i>Titre/Title</i>	<i>Management Characteristics and the Performance of Small and Mid Cap Mutual Funds</i>	<i>Corporate Finance From the Perspective of Bondholders: A Contribution to the Practice of Rational Financial Contracting</i>	<i>Portfolio Selection with Higher-order L-Moments: A Robust Non-parametric Multi-moment efficient Frontier</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>La gouvernance et la décision d'alerte aux resultants</i>	<i>La gouvernance d'entreprise efficiente: une approche indicielle par la méthode de la frontière stochastique</i>	<i>Contribution à la vision systémique de la gouvernance des entreprises : l'influence des autres mécanismes sur le rôle du marché des dirigeants, une revue de la littérature</i>
Commentateur/ Discussant	Jurczenko Emmanuel & Maillet Bertrand & Yanou Ghislain	Switzer Lorne & Huang Yanfen	Krainer Robert	Commentateur/ Discussant	Allemand Isabelle	Francoeur Claude & Labelle Réal & Martinez Isabelle	Khiari Wided & Karaa Adel & Omri Abdelwahed
Session 3				Session 4			
Salle/Room : 203	Finance d'entreprise		CHAIRPERSON Patrick NAVATTE	Salle/Room : 300	Mathematical Finance		CHAIRPERSON Hélène RAINELLI
Code	28	201	130	Code	152	158	171
<i>Auteur/Author</i>	Latrous Imen	Perdreau Frédéric & Le Nadant Anne Laure & Cliquet Gérard	Bejar Yosra	<i>Auteur/Author</i>	Attaoui Sami	Bagnarosa Guillaume & Corrado Charles & Jurczenko Emmanuel & Maillet Bertrand	Bertrand Philippe & Protopo pescu Costin
<i>Titre/Title</i>	<i>Structure de propriété et structure du capital : Approche par la méthode des équations simultanées</i>	<i>Architecture financière des réseaux de franchise : apports de la théorie des ressources et de la théorie des contrats incomplets</i>	<i>Le Pouvoir Informationnel du Capital Immatériel et les Signaux Classiques de la Littérature : Le cas des entreprises technologiques nouvellement introduites en bourse.</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Pricing Cross-Currency Derivatives in a Libor Market Model</i>	<i>An Implicit Martingale Restriction in a Closed-form Higher Order Moments Option Pricing Formula based on Multipoint Padé Approximants</i>	<i>The Statistics of The Information Ratio</i>
Commentateur/ Discussant	Bejar Yosra	Latrous Imen	Perdreau Frédéric & Le Nadant Anne Laure & Cliquet Gérard	Commentateur/ Discussant	Bagnarosa Guillaume & Corrado Charles & Jurczenko Emmanuel & Maillet Bertrand	Bertrand Philippe & Protopo pescu Costin	Attaoui Sami

Mercredi/Wednesday - June. 27. 2007 - 11:30-13:00

Session 5				Session 6			
Salle/Room : 301	Finance de marché		CHAIRPERSON Georges GALLAIS- HAMONNO	Salle/Room : 302	Asset Pricing		CHAIRPERSON Jean-Luc PRIGENT
Code	35	114	30	Code	38	42	50
<i>Auteur/Author</i>	Bouden Amine	Benletaifa Asma	Zouaoui Mohamed & Watfa Mohamad	<i>Auteur/Author</i>	Malevergne Yannick & Sornett D.	Bajo Emanuele & Barbi Massimiliano	Roger Patrick
<i>Titre/Title</i>	<i>Comparison of Risk Neutral Density Estimation Methods using Monte Carlo Simulated Option Data</i>	<i>Les déterminants de la réaction du marché français aux annonces de rachats d'actions</i>	<i>Le risque sentiment: mythe ou réalité ?</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>A two-Factor Asset Pricing Model and the Fat Tail Distribution of Firm Sizes</i>	<i>The risk-shifting effect and the value of a warrant</i>	<i>Does the consciousness of the disposition effect increase the equity premium?</i>
Commentateur/ Discussant	Zouaoui Mohamed & Watfa Mohamad	Bouden Amine	Benletaifa Asma	Commentateur/ Discussant	Bajo Emanuele & Barbi Massimiliano	Roger Patrick	Malevergne Yannick & Sornett D.
Session 7				Session 8			
Salle/Room : 303	Finance d'entreprise		CHAIRPERSON Mondher BELLALAH	Salle/Room : 300	Corporate Finance		CHAIRPERSON Christian PRAT dit HAURET
Code	163	49	113	Code	9	32	37
<i>Auteur/Author</i>	Mellouli Yosra	Janin Rémi & Piot Charles	Colot Olivier & Bughin Christiane & Croquet Mélanie	<i>Auteur/Author</i>	Belhaj Mohamed & Djembissi Bertrand	Moraux Franck & Navatte Patrick	Meftah Salma & Oliver Barry
<i>Titre/Title</i>	<i>Les programmes de rachats d'action et les caractéristiques financières des entreprises: le cas français</i>	<i>Qualité de l'audit et évaluation des manipulations comptables par le marché</i>	<i>Ratio cible d'endettement et comportement financier des grandes entreprises non cotées : une étude empirique belge</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Optimal Investment under Credit Constraint</i>	<i>Business Risk Targeting And Rescheduling of Distressed Debt</i>	<i>Capital structure choice: the influence of confidence in France</i>
Commentateur/ Discussant	Janin Rémi & Piot Charles	Colot Olivier & Bughin Christiane & Croquet Mélanie	Mellouli Yosra	Commentateur/ Discussant	Meftah Salma & Oliver Barry	Belhaj Mohamed & Djembissi Bertrand	Moraux Franck & Navatte Patrick

Mercredi/Wednesday - June. 27. 2007 - 14:30-16:00

Session 9				Session 10				Session 11			
Salle/Room : 200	Finance de marché		CHAIRPERSON Patrice FONTAINE	Salle/Room : 201	Behavioral Finance		CHAIRPERSON Dilip GHOSH	Salle/Room : 203	Finance bancaire		CHAIRPERSON Eric LAMARQUE
Code	199	189	86b	Code	72	93	110	Code	187	179	218
<i>Auteur/Author</i>	Bouattour Mondher & Boujelbene Younes	Belkhir Boujelbène Nadia & Bour Abdelfatteh & Prigent Jean-Luc	Obeid Hassan	<i>Auteur/Author</i>	Aharoni Gil & Sarig Oded	Ang James & Boyer Carol	Cavezzali Elisa & Rigoni Ugo	<i>Auteur/Author</i>	Essid Zina & Boujelbène Younes	Pallas-Saltiel Valérie	Bernoussi Achraf & Dereeper Sébastien
<i>Titre/Title</i>	<i>Annnonce de dividende, signalisation et risque de surinvestissement. Vérifications sur le marché boursier français</i>	<i>Impact de la structure de propriété sur la liquidité des titres : étude empirique dans le contexte d'un pays émergent</i>	<i>La performance boursière des entreprises françaises privatisées</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Hot Hands in Basketball and Equilibrium</i>	<i>Has the 1987 crash changed the psyche of the stock market? The evidence from IPOs</i>	<i>Investor Profile and Asset Allocation Advice</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Déterminants institutionnels de l'instabilité bancaire</i>	<i>Le pool bancaire : une coordination problématique</i>	<i>Syndicats bancaires, risques de placement et réputation du chef de file</i>
Commentateur/ Discussant	Belkhir Boujelbène Nadia & Bour Abdelfatteh & Prigent Jean-Luc	Obeid Hassan	Bouattour Mondher & Boujelbene Younes	Commentateur/ Discussant	Cavezzali Elisa & Rigoni Ugo	Aharoni Gil & Sarig Oded	Ang James & Boyer Carol	Commentateur/ Discussant	Bernoussi Achraf & Dereeper Sébastien	Essid Zina & Boujelbène Younes	Pallas-Saltiel Valérie
Session 12				Session 13				Session 14			
Salle/Room : 300	Insurance		CHAIRPERSON Monique JEANBLANC	Salle/Room : 301	Financial Modelling		CHAIRPERSON Patrick ROGER	Salle/Room : 302	Gouvernance d'entreprise		CHAIRPERSON Alain SCHATT
Code	100	95	17	Code	92	105	109	Code	150	208	186
<i>Auteur/Author</i>	Bruneau Catherine & Sghaier Nadia	Ben Ameer Hechmi & Prigent Jean-Luc	Le Courtois Olivier & Quittard-Pinon François	<i>Auteur/Author</i>	Mkaouar Farid & Prigent Jean-Luc	Boucher Christophe & Maillet Bertrand & Michel Thiery	Darolles Serge & Mero Gulten	<i>Auteur/Author</i>	Marsal Christine & Bouaiss Karima	Barredy Céline & Darras Nathalie	Fakhfakh Hamadi & Ben Jedidia Lotfi & Ben Atitallah Rihab
<i>Titre/Title</i>	<i>Les cycles de souscription de l'assurance non vie en France</i>	<i>Portfolio Insurance: determination of a dynamic CPPI multiple as function of state variables.</i>	<i>Fair Valuation of Participating Life Insurance Contracts with Jump Risk</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Portfolio Insurance with transaction costs: The case of the CPPI method</i>	<i>Misalignments and Aggregated Volatility</i>	<i>Hedge Funds Replication and Factor Models</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Les mécanismes internes de gouvernance dans les banques : un état de l'art</i>	<i>L'utilisation d'internet dans la communication auprès des actionnaires minoritaires dans les entreprises familiales</i>	<i>L'investigation empirique gouvernance d'entreprise - politique de financement : quelles difficultés pour les pays émergents ?</i>
Commentateur/ Discussant	Ben Ameer Hechmi & Prigent Jean-Luc	Le Courtois Olivier & Quittard-Pinon François	Bruneau Catherine & Sghaier Nadia	Commentateur/ Discussant	Boucher Christophe & Maillet Bertrand & Michel Thiery	Darolles Serge & Mero Gulten	Mkaouar Farid & Prigent Jean-Luc	Commentateur/ Discussant	Barredy Céline & Darras Nathalie	Fakhfakh Hamadi & Ben Jedidia Lotfi & Ben Atitallah Rihab	Marsal Christine & Bouaiss Karima

Session 15			
Salle/Room : 303	Corporate Governance		CHAIRPERSON Jacques THEPOT
Code	146	60	135
<i>Auteur/Author</i>	Aman Hiroyuki & Nguyen Pascal	Dietsch Michel & Hamelin Anais & Torjman Joseph	Praet Alain
<i>Titre/Title</i>	<i>Do Stock Prices Reflect the Corporate Governance Quality of Japanese Firms</i>	<i>Family ownership and growth : the case of French SME</i>	<i>How does family Ownership affect voluntary restructuring decision?</i>
Commentateur/ Discussant	Praet Alain	Aman Hiroyuki & Nguyen Pascal	Dietsch Michel & Hamelin Anais & Torjman Joseph

Mercredi/Wednesday - June. 27. 2007 - 16:30-18:00

Session 16			Session 17				Session 18				
Salle/Room : 200	Ethics & Finance		CHAIRPERSON Sébastien DEREEPER	Salle/Room : 201	Marchés financiers		CHAIRPERSON Pedro ARBULU	Salle/Room : 203	Mathematical Finance		CHAIRPERSON
Code	140	181	97	Code	15	16	157	Code	96	204	80
Auteur/Author	Salaber Julie	Brana Sophie & Jegourel Yves	Boussabah Monia	Auteur/Author	Yao Jean-Marie	Ayayi Ayi & Noël Christine	El Mir Ali & Benklifa Monia	Auteur/Author	Hentati Rania & Prigent Jean-Luc	Houfi Mohamed Ali & Kouki Mokhtar	Laaradh Kamel
Titre/Title	<i>The Determinants of Sin Stock Returns: Evidence on the European Market</i>	<i>Microfinance in France: an evaluation of its social and financial impacts</i>	<i>Adoption des recommandations des codes de bonne conduite: pour une meilleure Rentabilité ou Réputation ?</i>	Titre/Title	<i>Attractivité des places financières et fragmentation de l'activité dans l'industrie des fonds d'investissement</i>	<i>Réglementation financière et attractivité des marchés financiers Une comparaison des cadres Nord-Américain et Français</i>	<i>Les annonces de résultat et les composantes de la fourchette de prix Application à la bourse de Tunis</i>	Titre/Title	<i>Optimisation de mesures de performance: le cas des hedge funds</i>	<i>Modèles non linéaires et tests d'efficience informationnelle</i>	<i>La diversification internationale profite-t-elle aux fonds de pension ? Illustration britannique</i>
Commentateur/ Discussant	Boussabah Monia	Salaber Julie	Brana Sophie & Jegourel Yves	Commentateur/ Discussant	El Mir Ali & Benklifa Monia	Yao Jean-Marie	Ayayi Ayi & Noël Christine	Commentateur/ Discussant	Laaradh Kamel	Hentati Rania & Prigent Jean-Luc	Houfi Mohamed Ali & Kouki Mokhtar
Session 19			Session 20				Session 21				
Salle/Room : 300	Relation banque-Entreprise		CHAIRPERSON Eric LAMARQUE	Salle/Room : 301	Finance quantitative		CHAIRPERSON Philippe GILLET	Salle/Room : 302	Corporate Governance		CHAIRPERSON Jacques THEPOT
Code		164	120	Code	67	82	64	Code	98	21	143
Auteur/Author		Hajj Chehade Hiba	Andrieu Guillaume	Auteur/Author	Kermiche Lamya	Dorn Jochen	Ben Rayana Mehdi & Jilani Faouzi & Denguisli Hassib	Auteur/Author	Le maux Julien	Thepot Jacques	Kouki Mondher
Titre/Title	ANNULE CANCELLED	<i>Les déterminants de la multibancarité de la PME: Une étude empirique sur le marché belge</i>	<i>Choix de financement par société de capital-risque indépendante ou affiliée à un réseau bancaire</i>	Titre/Title	<i>Une modélisation de la surface de volatilité implicite par processus à sauts</i>	<i>Modeling of CDO Squareds Capturing the second dimension</i>	<i>Eléments d'analyses de séries empiriques des indices boursiers et des taux de change : Cas des pays émergents</i>	Titre/Title	<i>Les primes de transactions de blocs en Europe</i>	<i>Jensen-Meckling equity model revisited</i>	<i>Stock Options and Firm Dividend Policy: Evidence from Toronto Stock Exchange</i>
Commentateur/ Discussant		Andrieu Guillaume	Hajj Chehade Hiba	Commentateur/ Discussant /	Dorn Jochen	Ben Rayana Mehdi & Jilani Faouzi & Denguisli Hassib	Kermiche Lamya	Commentateur/ Discussant /	Kouki Mondher	Le maux Julien	Thepot Jacques

Jeudi/Thursday - June. 28. 2007 - 11:00-12:30

Session 23			Session 24				Session 25				
Salle/Room : 200	Banking		CHAIRPERSON Ivelina PAVLOVA	Salle/Room : 201	Market Finance		CHAIRPERSON Jean-François GAJEWSKI	Salle/Room : 203	Liens théorie/pratique en Finance		CHAIRPERSON Hervé ALEXANDRE
Code	156	11	ANNULE CANCELLED	Code	36	213	39	Code	192	215	31
<i>Auteur/Author</i>	Dubuisson Marie	Liebeg David & Schwaiger Markus		<i>Auteur/Author</i>	Clark Ephraim & Judge Amrit & Meftah Salma	Palard Jean-Etienne	Miloud Tarek	<i>Auteur/Author</i>	Bertrand Jean-louis	Roth Fabrice & Louizi Amir	Maurer Frantz
<i>Titre/Title</i>	<i>Performance of exchange-traded funds listed on the euronext stock exchange</i>	<i>What derives the interest rate margin decline in EU banking – the case of small local banks</i>		<i>Titre/Title</i>	<i>Corporate Hedging With Foreign Currency Derivatives and Firm Value</i>	<i>Why has idiosyncratic volatility increased in Europe?</i>	<i>Operating Measures, IPO Valuation and the Aftermarket Performance: Perspective from internet bubble period</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Les entreprises Européennes face à la gestion des risques climatiques</i>	<i>Evaluation du Gouvernement d'entreprise par les Agences de Rating : Une analyse comparative des méthodes</i>	<i>Les développements récents de la mesure du risque opérationnel</i>
Commentateur/ Discussant	Liebeg David & Schwaiger Markus	Dubuisson Marie		Commentateur/ Discussant	Miloud Tarek	Clark Ephraim & Judge Amrit & Meftah Salma	Palard Jean-Etienne	Commentateur/ Discussant	Roth Fabrice & Louizi Amir	Maurer Frantz	Bertrand Jean-louis
Session 26			Session 27				Session 28				
Salle/Room : 300	Finance d'entreprise		CHAIRPERSON Isabelle MARTINEZ	Salle/Room : 301	Corporate Finance		CHAIRPERSON Sébastien DEREPER	Salle/Room : 302	Finance de marché		CHAIRPERSON Pierre CHOLLET
Code	7	142	200	Code	63	101	57	Code	191	203	43
<i>Auteur/Author</i>	Lobez Frédéric & Statnik Jean-Christophe	Ben Hamida Hela & Mamoghli Chokri	Sahut Jean-Michel & Othmani Gharbi Hidaya	<i>Auteur/Author</i>	Rau Raghu & Stouraitis Aris	Cicccone Stephen	Groh Alexander & von Liechtenstein Heinrich & Lieser Karsten	<i>Auteur/Author</i>	Charpin Françoise	Houfi Mohamed Ali & El Montasser Ghassen	Omet Ghassan
<i>Titre/Title</i>	<i>La complémentarité entre dette bancaire et dette obligataire : une interprétation en termes de signaux</i>	<i>Droits du propriétaire ultime et performance des firmes: une investigation dans le contexte des pays émergents</i>	<i>Structure d'actionariat et performance des firmes : Cas des entreprises de l'indice SBF 120</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Corporate Event Waves</i>	<i>Analysts' Annual Forecasts and Quarterly Earnings Releases</i>	<i>The Attractiveness of Central Eastern European Countries for Venture Capital and Private Equity Investors</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Gestion alternative de portefeuilles d'actions : la performance d'une stratégie zéro-bêta</i>	<i>Effets des points aberrants sur les tests de normalité et de linéarité Applications sur la bourse de Tokyo</i>	<i>Non-Debt Tax Shield and the Financial Structure in Different Institutional Settings: Saudi Arabia and Jordan</i>
Commentateur/ Discussant	Ben Hamida Hela & Mamoghli Chokri	Sahut Jean-Michel & Othmani Gharbi Hidaya	Lobez Frédéric & Statnik Jean-Christophe	Commentateur/ Discussant	Cicccone Stephen	Groh Alexander & von Liechtenstein Heinrich & Lieser Karsten	Rau Raghu & Stouraitis Aris	Commentateur/ Discussant	Omet Ghassan	Charpin Françoise	Houfi Mohamed Ali & El Montasser Ghassen

Session 29			
Salle/Room : 303	Financial Markets		CHAIRPERSON Patrice FONTAINE
Code	216	145	33
<i>Auteur/Author</i>	Ghosh Dilip K., Ghosh Dipasri, Shekhar Bhatnagar Chandra et Mishra Suchismita	Maillet Bertrand & Michel Thierry	Galy Nadine & Germain Laurent
<i>Titre/Title</i>	<i>Cross-listed Cross-Currency Assets and Arbitrage Opportunities with Forwards and Options</i>	<i>High Watermarks of Market Risk</i>	<i>Product market competition and share value: the Airbus-Boeing duopoly</i>
Commentateur/ Discussant	Maillet Bertrand & Michel Thierry	Galy Nadine & Germain Laurent	Ghosh Dilip K., Ghosh Dipasri, Shekhar Bhatnagar Chandra et Mishra Suchismita

Jeudi/Thursday - June. 28. 2007 - 13:45-15:15

Session 30			Session 31			Session 32					
Salle/Room : 200	Mathematical Finance		CHAIRPERSON Constantin MELLIOS	Salle/Room : 201	Financial Modelling		CHAIRPERSON Patrick ROGER	Salle/Room : 203	Finance bancaire		CHAIRPERSON Frédéric LOBEZ
Code	5	106	137	Code	115	162	178	Code	134	123	141
<i>Auteur/Author</i>	Pouget Jérôme	Attaoui Sami	Six Pierre	<i>Auteur/Author</i>	Maillet Bertrand & Merlin Paul	Bajgrowicz Pierre & Scaillet Olivier	Laurent Marie-Paule & Schmit Mathias	<i>Auteur/Author</i>	Godlewski Christophe	Distinguin Isabelle	Ait Bihi Abdelhamid
<i>Titre/Title</i>	<i>Modélisation de la sélection adverse en capital risqué par la théorie des jeux</i>	<i>A Stochastic Volatility Swap Market Model</i>	<i>Optimal consumption and portfolio strategies when relative risk aversion from consumption differs from relative risk aversion from wealth</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Hedge Funds Time Series Completion for Robust Asset Allocation and Risk Measurement</i>	<i>Technical Trading Rules Performance under Transaction Costs: Measuring Data Snooping with the False Discovery Rate</i>	<i>An Empirical Approach to Estimate Residual Value Risk and its Interconnection with Credit Risk</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Caractéristiques du Contrat de Prêt et Décision de Syndication en France</i>	<i>Discipline de marché et surveillance prudentielle des banques : le rôle de la dette subordonnée</i>	<i>Le niveau des fonds propres bancaires entre la théorie financière et la réglementation prudentielle : une revue de la littérature</i>
Commentateur/ Discussant	Six Pierre	Pouget Jérôme	Attaoui Sami	Commentateur/ Discussant	Laurent Marie-Paule & Schmit Mathias	Maillet Bertrand & Merlin Paul	Bajgrowicz Pierre & Scaillet Olivier	Commentateur/ Discussant	Distinguin Isabelle	Ait Bihi Abdelhamid	Godlewski Christophe
Session 33			Session 34			Session 35					
Salle/Room : 300	Gouvernance d'entreprise		CHAIRPERSON Gérard HIRIGOYEN	Salle/Room : 301	Asset Pricing		CHAIRPERSON Emmanuelle GABILLON	Salle/Room : 302	Finance de marché		CHAIRPERSON Pedro ARBULU
Code	206	68	166	Code	102	144	45	Code	168	220	221
<i>Auteur/Author</i>	Gharbi Héla & Lepers Xavier	Kasbi Salma	Abdelkefi Mariam	<i>Auteur/Author</i>	Tahani Nabil & Li Xiaofei	Kouontchoui Patrick & Maillet Bertrand	Hamisultane Helene	<i>Auteur/Author</i>	Gallais-Hamonno Georges & Hoang Thi-Hong-Van. & Nguyen Thi Thanh Huyen	Agarwal Aman	Agarwal Aman
<i>Titre/Title</i>	<i>Actionnariat salarié et enracinement des dirigeants : vers une compréhension fondée sur la théorie du pouvoir et de la dépendance</i>	<i>Bankers on board, banks shareholders and conflicts of interest. Evidence from the french market</i>	<i>Pourquoi les firmes françaises émettent-elles des actions à leurs salariés?</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Pricing Interest Rate Derivatives under Stochastic Volatility</i>	<i>High-frequency Market Risk Scenarii by Independent Component Analysis: Method and Application</i>	<i>Utility-Based Pricing of the Weather Derivatives</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>La nécessité de corriger les rentabilités des hedge funds : preuve empirique et méthode de correction</i>	<i>A communiquer ultérieurement</i>	<i>A communiquer ultérieurement</i>
Commentateur/ Discussant	Abdelkefi Mariam	Gharbi Héla & Lepers Xavier	Kasbi Salma	Commentateur/ Discussant	Hamisultane Helene	Tahani Nabil & Li Xiaofei	Kouontchoui Patrick & Maillet Bertrand	Commentateur/ Discussant	Agarwal Aman	Gallais-Hamonno Georges & Hoang Thi-Hong-Van. & Nguyen Thi Thanh Huyen	Gallais-Hamonno Georges & Hoang Thi-Hong-Van. & Nguyen Thi Thanh Huyen

Jeudi/Thursday - June. 28. 2007 - 15:30-17:00

Session 37			Session 38			Session 39					
Salle/Room : 200	Market Finance		CHAIRPERSON Jérôme POUGET	Salle/Room : 201	Financial restructuring		CHAIRPERSON Pascal BARNETO	Salle/Room : 202	Banking Finance		CHAIRPERSON Dominique LACOUÉ-LABARTHE
Code	132	136	174	Code	19	124	182	Code	148	41	217
<i>Auteur/Author</i>	Burlacu Radu & Fontaine Patrice & Jimenez Sonia	Pop Diana	Brahmi Belghith Nada	<i>Auteur/Author</i>	Luypaert Mathieu & Huyghebaert Nancy	Huang Weihua & Zhao Shan	Lorenz Johannes-T. & Schiereck Dirk	<i>Auteur/Author</i>	Adam Alexandre & Houkari Mohamed & Laurent Jean-Paul	Herkommer Dirk	Hibbert Ann Marie, Pavlova Ivelina et Dandapani Krishnan
<i>Titre/Title</i>	<i>Information, Risk and Performance of Actively Managed Mutual Funds</i>	<i>Stepping up to the edge : Delisting preassur in a frontier emerging market</i>	<i>Analysis of structured funds performances: An empirical study</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Determinants of Growth through Mergers and Acquisitions: An Empirical Analysis</i>	<i>When debt is bad news: Market Reaction to Debt Announcements under Poor Governance</i>	<i>Completed Versus Cancelled Banking M&A Transactions in Europe</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Hedging Interest Rate Margins on Demand Deposits</i>	<i>Recovery Rates in Credit Default Models: Theory and Application to Corporate Bonds</i>	<i>Determinants of the Credit Spread: Further Evidence on the Relationship between Market and Credit Risk</i>
Commentateur/ Discussant	Pop Diana	Brahmi Belghith Nada	Burlacu Radu & Fontaine Patrice & Jimenez Sonia	Commentateur/ Discussant	Lorenz Johannes-T. & Schiereck Dirk	Luypaert Mathieu & Huyghebaert Nancy	Huang Weihua & Zhao Shan	Commentateur/ Discussant	Herkommer Dirk	Hibbert Ann Marie, Pavlova Ivelina et Dandapani Krishnan	Adam Alexandre & Houkari Mohamed & Laurent Jean-Paul
Session 40			Session 41			Session 42					
Salle/Room : 300	Corporate Governance		CHAIRPERSON Fabrice ROTH	Salle/Room : 301	Audit et finance		CHAIRPERSON Stéphane ONNEE	Salle/Room : 302	Financial Modelling		CHAIRPERSON Franz MAURER
Code	25	169	3	Code	23	14	211	Code	73	149	121
<i>Auteur/Author</i>	Bigelli Marco & Mehrotra Vikas & Rau P. Raghavendra	Ellul Andrew & Levent Guntay & Lel Ugur	Adjaoud Fodil & Ben-AmarWalid	<i>Auteur/Author</i>	Manita Riadh	Ben Hamida Nessrine	Bellalah Mondher & Saihi Malek	<i>Auteur/Author</i>	Guégan Dominique & Ielpo Florian	Pericoli Marcello & Taboga Marco	Hamidi Benjamain & Jurczenko Emmanuel & Maillet Bertrand
<i>Titre/Title</i>	<i>Expropriation, Unification, and Corporate Governance in Italy</i>	<i>External Governance and Debt Agency Costs of Family Firms</i>	<i>Corporate Governance Quality and Dividend Policy: Shareholders' protection or expropriation?</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Le comité d'audit et la qualité de l'audit externe : quelle interaction ?</i>	<i>Évaluation empirique des impacts des événements ayant abouti à l'adoption de l'IAS 39 sur les cours boursiers des banques françaises cotées</i>	<i>Origine et évolution de la réglementation relative à l'adéquation des fonds propres</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Subjective Distribution and Risk Aversion for Monetary Policy Analysis</i>	<i>Canonical term-structure models with observable factors and the dynamics of bond risk premia</i>	<i>An Extended Expected CaViaR Approach for CPPI</i>
Commentateur/ Discussant	Adjaoud Fodil & Ben-AmarWalid	Bigelli Marco & Mehrotra Vikas & Rau P. Raghavendra	Ellul Andrew & Levent Guntay & Lel Ugur	Commentateur/ Discussant	Bellalah Mondher & Saihi Malek	Manita Riadh	Ben Hamida Nessrine	Commentateur/ Discussant	Hamidi Benjamain & Jurczenko Emmanuel & Maillet Bertrand	Guégan Dominique & Ielpo Florian	Pericoli Marcello & Taboga Marco

Session 43			
Salle/Room : 303	Finance et entreprise familiale		CHAIRPERSON G�rard HIRIGOYEN
Code	197	209	219
Auteur/Author	Basly Sami	Labaki Rania	Chikh Sabrina
Titre/Title	<i>Le conservatisme : une explication des choix financiers de la PME familiale</i>	<i>Le concept d'engagement : une explication de la performance des entreprises familiales</i>	<i>L'effet "dirigeant" sur la performance des firmes fran�aises</i>
Commentateur/ Discussant	Chikh Sabrina	Basly Sami	Labaki Rania

Vendredi/friday - June. 29. 2007 - 11:00-12:30

Session 44				Session 46				Session 47			
Salle/Room : 200	Finance et stratégie		CHAIRPERSON Thierry VERSTRAETE	Salle/Room : 203	Finance de marché		CHAIRPERSON Georges GALLAIS- HAMONNO	Salle/Room : 300	Gouvernance d'entreprise		CHAIRPERSON Gérard HIRIGOYEN
Code	8	175	198	Code	78	94	154	Code	147	125	29
<i>Auteur/Author</i>	Palard Jean-Etienne	Trowski Christophe	André-Le Pogamp Florence & Perdreau Frederic	<i>Auteur/Author</i>	Laaradh Kamel & Maillet Bertrand	Sodjahin William & Beaulieu Marie-Claude	Saadi Taieb	<i>Auteur/Author</i>	Idi Cheffou Abdoukarim	Fadil Nazik & Ayouz Mourad	Finet Alain & Pardo Jonathan
<i>Titre/Title</i>	<i>Les déterminants des opérations de recentrage stratégique en Europe (1987-2003) Propriété, Performance et Endettement</i>	<i>Optimise managérial, efficience des marchés financiers et straétgies des fusions et acquisitions</i>	<i>Stratégies de diversification et structure du capital</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Tests non-paramétriques de la persistance de la performance des fonds : une illustration britannique</i>	<i>Politique du fractionnement d'actions: facteur de fractionnement, annonce et timing de réalisation</i>	<i>EVA Vs. résultat net : Quel contenu informationnel dans le contexte français ?</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>Les Stock-options en faveur des dirigeants : déterminants d'octroi et impact sur la performance des entreprises, le cas francois</i>	<i>La gouvernance par le marché financier et la performance : tests à partir d'un modèle dynamique à équations simultanées appliqués aux PME</i>	<i>Les entrées en Bourse sur le marché français. Analyse de l'importance des données de gouvernance et de performance pour les investisseurs</i>
Commentateur/ Discussant	Trowski Christophe	André-Le Pogamp Florence & Perdreau Frederic	Palard Jean-Etienne	Commentateur/ Discussant	Sodjahin William & Beaulieu Marie-Claude	Saadi Taieb	Laaradh Kamel & Maillet Bertrand	Commentateur/ Discussant	Finet Alain & Pardo Jonathan	Idi Cheffou Abdoukarim	Fadil Nazik & Ayouz Mourad
Session 48				Session 49				Session 50			
Salle/Room : 301	Corporate Finance		CHAIRPERSON Serge EVRAERT	Salle/Room : 302	Relationship Banking		CHAIRPERSON Valérie PALLAS	Salle/Room : 303	Finance d'entreprise		CHAIRPERSON Olivier BRANDOUY
Code	6	52	129	Code	127	77	117	Code	196	205	70
<i>Auteur/Author</i>	Weill Laurent & Godlewski Christophe	Switzer Lorne	Levy Marc	<i>Auteur/Author</i>	Hajj Chehade Hiba & Vigneron Ludovic	Jarboui Anis & Fakhfakh Hamadi	Cadot Julien & Couderc Jean-Pierre	<i>Auteur/Author</i>	Atrissi Nizar	Evraert Frédérique	Matoussi Hamadi & Krichene Aida
<i>Titre/Title</i>	<i>Does Collateral Help Mitigate Adverse Selection? A Cross-Country Analysis</i>	<i>Corporate Governance, Sarbanes-Oxley, and Small-Cap Firm Performance</i>	<i>Control in Pyramidal Structures</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>SME's main bank choice and organizational structure: evidence from France</i>	<i>The Banks Role in Reinforcing the Development Strategy of Specific Investments Through their Presence in the Board and their Contribution in Non-Banks Capital</i>	<i>A model of adaptive relationship between the entrepreneur and the bank</i>	<i>Titre/Title</i>	<i>La Structure Financière dans un Environnement Inflationniste : l'Impact de la Procédure de Réévaluation des Actifs</i>	<i>L'influence des variables non financières dans l'évaluation des entreprises de NTIC françaises: étude d'évènement pour la période 2000-2002</i>	<i>Prévision du risque des crédits de gestion par les modèles basés sur les réseaux de neurones artificiels</i>
Commentateur/ Discussant	Switzer Lorne	Levy Marc	Weill Laurent & Godlewski Christophe	Commentateur/ Discussant	Cadot Julien & Couderc Jean-Pierre	Hajj Chehade Hiba & Vigneron Ludovic	Jarboui Anis & Fakhfakh Hamadi	Commentateur/ Discussant	Matoussi Hamadi & Krichene Aida	Atrissi Nizar	Evraert Frédérique