

Βιογραφικό σημείωμα

Καθηγητής Κώστας Γιαννόπουλος

Ο καθηγητής Κώστας Γιαννόπουλος είναι επικεφαλής στο Masters Τραπεζικών και Χρηματοοικονομικών Επιστημών του Πανεπιστημίου Νεάπολις. Ο καθηγητής Γιαννόπουλος κατέχει πτυχίο (Laurea) στα Τραπεζικά και Χρηματοοικονομικά από το Πανεπιστήμιο της Σιένα, Ιταλία. Κατέχει επίσης πτυχίο σε Τραπεζικά και Χρηματοοικονομικά από το Πανεπιστήμιο της Ουαλίας και διδακτορικό στα Χρηματοοικονομικά από το London Guildhall University.

Ο καθηγητής Γιαννόπουλος δίδαξε σε πανεπιστήμια του Westminster, City business school, London Guildhall, UEU University, British University in Dubai. Είναι επίτιμος επιστημονικός συνεργάτης της Ρωσικής ακαδημίας επιστημών.

Ο καθηγητής Γιαννόπουλος έχει δημοσιεύσει ευρέως σε διεθνή επιστημονικά περιοδικά. Η ερευνητική του δράση σχετικά με την ανάλυση του χρηματοοικονομικού κινδύνου.

Ο καθηγητής Γιαννόπουλος υπηρέτησε ως μέλος της οργανωτικής επιτροπής για GARP και PRMIA, δύο διεθνείς οργανισμούς στον τομέα της διαχείρισης χρηματοοικονομικών Κινδύνων (market risk management) και ως περιφερειακός διευθυντής της PRMIA για πέντε χρόνια.

Publications

- 2020 “Brexit and the Dependence Structure among the G7 Bank Equity Markets” (with Ramzi Nekhili), *Investment Management and Financial Innovations*, **17**, 2.
- 2018 “Estimating the joint tail risk under the filtered historical simulation. An application to the CCP’s default and waterfall fund” (with G Barone-Adesi and L. Vosper), *European Journal of Finance*, **24**(5), 413-425.
- 2014 “Backtesting Derivative Portfolios with FHS” (with G Barone-Adesi and L Vosper), published in *Simulating Securities Returns, a Filtered Historical Simulation Approach*, edited by G Barone-Adesi, Springer, pp 9-29.
- 2014 “VaR without Correlations for Portfolios of Derivative Securities “ (with Giovanni Barone Adesi and Les Vosper), published in *Simulating*

Securities Returns, a Filtered Historical Simulation Approach, edited by G Barone-Adesi, Springer, pp 30-65.

- 2012 “A market risk model for asymmetric distributed series of return” (with R. Nekhili), *International Research Journal of Applied Finance*, **3**, 1, 106-114.
- 2010 "Volatility spillovers and price interdependencies; A dynamic non parametric approach", (with G Koutmos and R Nekhili), *International Research Journal of Finance and Economics*, **45**, 114-21 .
- 2008 “Nonparametric, conditional pricing of higher order multivariate contingent claims”, *The Journal of Banking and Finance*, **32**, 9, 1907-1915.
- 2005 “Coherent risk measures under filtered historical simulation”, (with R Tunaru), *The Journal of Banking and Finance*, **29**, 979-996.
- 2005 "Portfolio selection under VaR constrains”, (with E Clark and R Tunaru), *Computational Management Science*, **2**, 123-138.
- 2003 “VaR modelling on long-run horizons”, *Abtomatika u Telemexahnka (in Russian*, published by the institute of control sciences, Russian Academy of Sciences, No 7 2003, 87-93, ISSN 0005-2310 . Published in English by *Automation and Remote Control*, **64**, 7, 1094-1100 .
- 2003 “Dynamic mechanisms of volatility transmission among national stock markets”, (with G Cifarelli), *International Journal of Finance*, **14**, 2, 2216-43.
- 2002 “Backtesting derivative portfolios with filtered historical simulation”, (with G Barone-Adesi and L Vosper), *European Financial Management*, **8**, 1, 31-58.
- 2001 “Non-parametric VaR techniques; myths and realities”, (with G Barone-Adesi), *Economic Notes*, **30**, July, 167-181.
- 1999 “Market risk: parametric or non-parametric?” (with G Barone-Adesi), *Risk Professional*, **1**, 4.
- 1999 “VaR without correlations for non-linear portfolios” (with G Barone-Adesi and L Vosper), *Journal of Futures Markets*, **19**, August, 583-602. (373 citations on scholar)
- 1998 “Don’t look back” (with G Barone-Adesi and F Bourgoïn), *Risk*, **11**, August, 100-104. (216 citations on scholar)
- 1995 “Estimating the time-varying components of international stock markets’ risk”, *The European Journal of Finance*, **1**, 129-165.

Citation Metrics

Researcherid Author ID: A-1760-2014 (<http://www.researcherid.com>). .

Scopus Author ID: 6603157105

Google Scholar: <http://scholar.google.com/citations?user=vqzEa1QAAAAJ&hl=en>