

ΒΙΟΓΡΑΦΙΚΟ ΣΗΜΕΙΩΜΑ

1. ΠΡΟΣΩΠΙΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ

ΕΠΩΝΥΜΟ: ΡΟΜΠΟΛΗΣ

ΟΝΟΜΑ: ΛΕΩΝΙΔΑΣ

ΟΝΟΜΑ ΠΑΤΡΟΣ: ΣΑΒΒΑΣ

ΧΡΟΝΟΛΟΓΙΑ ΓΕΝΝΗΣΗΣ: 16/1/1977

ΤΟΠΟΣ ΓΕΝΝΗΣΗΣ: ΑΘΗΝΑ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΚΑΤΟΙΚΙΑΣ: ΟΙΚΟΝΟΜΟΥ 29, 16122, ΑΘΗΝΑ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΡΓΑΣΙΑΣ: ΠΑΤΗΣΙΩΝ 76, 10434, ΑΘΗΝΑ

ΤΗΛΕΦΩΝΟ ΕΡΓΑΣΙΑΣ: 2108203465

E-MAIL: rompolis@aueb.gr

ΣΤΡΑΤΙΩΤΙΚΕΣ ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ: ΕΚΠΛΗΡΩΜΕΝΕΣ

2. ΣΠΟΥΔΕΣ

ΙΟΥΛΙΟΣ 2002 – ΦΕΒΡΟΥΑΡΙΟΣ 2006:

Εκπόνηση διδακτορικής διατριβής στο Τμήμα Λογιστικής και Χρηματοοικονομικής του Οικονομικού Πανεπιστημίου Αθηνών με θέμα: «Εκτίμηση της κατανομής ουδετέρου κινδύνου και πρόβλεψη των μελλοντικών αποδόσεων των περιουσιακών στοιχείων με την χρήση των ροπών ουδετέρου κινδύνου».

ΣΕΠΤΕΜΒΡΙΟΣ 1999 – ΣΕΠΤΕΜΒΡΙΟΣ 2000:

Μεταπτυχιακός τίτλος (DEA) στη «Στατιστική και τα Στοχαστικά Υποδείγματα στην Οικονομία και τα Χρηματοοικονομικά», Πανεπιστήμια Paris 7 – Paris 1 και ENSAE.

Τίτλος μεταπτυχιακής εργασίας: Flexible least squares betas: the Greek market case.

ΙΟΥΝΙΟΣ 1994 – ΣΕΠΤΕΜΒΡΙΟΣ 1999:

Πτυχιούχος του Μαθηματικού Τμήματος του Πανεπιστημίου Αθηνών.

3. ΞΕΝΕΣ ΓΛΩΣΣΕΣ

ΑΓΓΛΙΚΑ (PROFICIENCY OF CAMBRIDGE)

ΓΑΛΛΙΚΑ (DIPLOME APPROFONDI DE LA LANGUE FRANCAISE)

4. ΕΠΑΓΓΕΛΜΑΤΙΚΗ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΑ

ΙΟΥΝΙΟΣ 2013 – : Επίκουρος Καθηγητής Χρηματοοικονομικής στο Τμήμα Λογιστικής και Χρηματοοικονομικής του Οικονομικού Πανεπιστημίου Αθηνών

ΣΕΠΤΕΜΒΡΙΟΣ 2010 – ΙΟΥΝΙΟΣ 2013: Λέκτορας Χρηματοοικονομικής στο Τμήμα Λογιστικής και Χρηματοοικονομικής του Οικονομικού Πανεπιστημίου Αθηνών

ΣΕΠΤΕΜΒΡΙΟΣ 2008 – ΣΕΠΤΕΜΒΡΙΟΣ 2010:

Λέκτορας στο Τμήμα Δημόσιας Διοίκησης και Διοίκησης Επιχειρήσεων, Πανεπιστήμιο Κύπρου.

ΣΕΠΤΕΜΒΡΙΟΣ 2006 – ΙΟΥΝΙΟΣ 2008:

Επισκέπτης Λέκτορας στο Τμήμα Δημόσιας Διοίκησης και Διοίκησης Επιχειρήσεων, Πανεπιστήμιο Κύπρου.

ΟΚΤΩΒΡΙΟΣ 2000 – ΙΑΝΟΥΑΡΙΟΣ 2001:

Τμήμα μελετών και ανάπτυξης εργασιών του Χρηματιστηρίου Παραγωγών Αθηνών.

ΙΟΥΝΙΟΣ 2000 – ΟΚΤΩΒΡΙΟΣ 2000:

Πρακτική άσκηση στα πλαίσια του μεταπτυχιακού στη Διεύθυνση μελετών και οικονομικής ανάπτυξης της Εθνικής Τράπεζας της Ελλάδος και πραγματοποίηση εργασίας με τίτλο: «flexible least squares betas: the Greek market case».

5. ΔΙΟΙΚΗΤΙΚΟ ΕΡΓΟ

ΙΑΝΟΥΑΡΙΟΣ 2016 - : Μέλος της επιτροπής του Τμήματος Λογιστικής και Χρηματοοικονομικής για θέματα καινοτομίας και επιχειρηματικότητας.

ΣΕΠΤΕΜΒΡΙΟΣ 2010 – ΣΕΠΤΕΜΒΡΙΟΣ 2011: Αναπληρωματικός εκπρόσωπος του Τμήματος Λογιστικής και Χρηματοοικονομικής στη Σύγκλητο του Οικονομικού Πανεπιστημίου Αθηνών.

6. ΕΡΕΥΝΗΤΙΚΗ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΑ

6.1. ΕΡΕΥΝΗΤΙΚΕΣ ΠΕΡΙΟΧΕΣ ΕΝΔΙΑΦΕΡΟΝΤΟΣ:

Αποτίμηση μετοχών, ομολόγων και παραγώγων προϊόντων, χρηματοοικονομικά μαθηματικά, χρηματοοικονομική υπολογιστική, χρηματοοικονομική οικονομετρία, χρηματοοικονομική διοίκηση επιχειρήσεων.

6.2. ΔΗΜΟΣΙΕΥΣΕΙΣ ΣΕ ΕΠΙΣΤΗΜΟΝΙΚΑ ΠΕΡΙΟΔΙΚΑ:

1. “Pricing and hedging contingent claims using variance and higher-order moment swaps” (with Elias Tzavalis), **Quantitative Finance 17 (2017), p. 531-550.**
2. “Retrieving risk neutral moments and expected quadratic variation from option prices” (with Elias Tzavalis), **Review of Quantitative Finance and Accounting 48 (2017), p. 955-1002.**
3. “Risk-free rates and variance futures prices”, **Journal of Futures Markets 36 (2016), p. 943-967.**
4. “Exploring the role of the realized return distribution in the formation of the implied volatility smile” (with George Chalmandaris), **Journal of Banking and Finance 36 (2012), p. 1028-1044.**
5. “Retrieving risk neutral densities from European option prices based on the principle of maximum entropy”, **Journal of Empirical Finance 17 (2010), p. 918-937.**

6. “Risk premium effects on implied volatility regressions” (with Elias Tzavalis), **Journal of Financial Research 33 (2010), p. 125-151.**
7. “Recovering risk neutral densities from option prices: A new approach” (with Elias Tzavalis), **Journal of Financial and Quantitative Analysis 43 (2008), p. 1037-1054.**
8. “Retrieving risk neutral densities based on risk neutral moments through a Gram-Charlier Series Expansion” (with Elias Tzavalis), **Mathematical and Computer Modeling 46 (2007), p. 225-234.**

6.3. ΔΗΜΟΣΙΕΥΣΕΙΣ ΣΕ ΣΥΛΛΟΓΙΚΟΥΣ ΤΟΜΟΥΣ:

“Η εκτίμηση των προτιμήσεων των επενδυτών με τη χρήση των τιμών των δικαιωμάτων προαίρεσης: Η περίπτωση του δείκτη FTSE ASE 20”, **Μελέτες για το Ελληνικό Χρηματοπιστωτικό Σύστημα**, Επιμέλεια έκδοσης: Η. Τζαβαλής, ΟΠΑ, Αθήνα 2010.

6.4. ΕΡΕΥΝΗΤΙΚΕΣ ΕΡΓΑΣΙΕΣ ΥΠΟ ΚΡΙΣΗ:

1. “Recovering the market risk premium from stock and option prices” (with George Chalamandaris) υπό κρίση από **European Financial Management.**
2. “Put-call parity violations and return predictability: Evidence from the 2008 short sale ban” (with George Nishiotis) υπό κρίση από **Journal of Banking and Finance.**

6.5. ΕΡΕΥΝΗΤΙΚΕΣ ΕΡΓΑΣΙΕΣ ΥΠΟ ΕΞΕΛΙΞΗ:

1. “GARCH option pricing with conditional skewness” (with Ioannis Papantonis and Elias Tzavalis).
2. “Modeling conditional skewness and kurtosis using a flexible semi-parametric approach” (with Ioannis Dendramis).
3. “The effectiveness of unconventional monetary policy on risk aversion and uncertainty”.

6.6. ΔΗΜΟΣΙΕΥΣΕΙΣ ΣΕ ΠΡΑΚΤΙΚΑ ΣΥΝΕΔΡΙΩΝ:

“Estimating Risk Neutral Densities of Asset Prices based on Risk Neutral Moments: An Edgeworth Expansion Approach” (with Elias Tzavalis), Proceedings of the International Conference of Computational Methods in Sciences and Engineering 2004.

6.7. ΠΑΡΟΥΣΙΑΣΕΙΣ ΕΡΓΑΣΙΩΝ ΣΕ ΕΠΙΣΤΗΜΟΝΙΚΑ ΣΥΝΕΔΡΙΑ:

1. “Recovering the market risk premium from stock and option prices” (with George Chalamandaris), 2016 European Financial Management Association Annual Meeting, Basel 2016.
2. “Pricing and hedging contingent claims using variance and higher-order moment swaps” (with Elias Tzavalis), 2014 Paris December Finance Meeting, Paris 2014.
3. “Estimating the market risk premium: Why the "shape" (of things to come) matters” (with George Chalamandaris), 2014 Paris Financial Management Conference, Paris 2014.
4. “Ex-ante estimates of market risk premium implied from realized and risk-neutral distributions” (with George Chalamandaris and George Skiadas), 4th National Conference of the Financial Engineering and Banking Society, Athens 2013.
5. Discussion of the paper “Quadratic variance swap models” (by Filipović, Gouriérouc and Mancini), 40th European Finance Association Annual Meeting, Cambridge 2013.
6. “Pricing and hedging contingent claims using variance and higher-order moment swaps” (with Elias Tzavalis), 2013 European Conference of Financial Management Association, Luxemburg 2013.
7. “Put-call parity violations and return predictability: Evidence from the 2008 short sale ban” (with George Nishiotis), 11th Conference on Research in Economic Theory and Econometrics, Milos 2012.
8. “Retrieving risk neutral moments and expected quadratic variation from option prices” (with Elias Tzavalis), 5th International Conference of Computational and Financial Econometrics, London 2011.
9. “Exploring the role of the realized return distribution in the formation of the implied volatility smile” (with George Chalamandaris), 3rd International Finance and Banking Society Conference, Rome 2011.

10. "Explaining the implied volatility smile using an adaptive expectations model" (with George Chalamandaris), 17th Annual Conference of the Multinational Finance Society, Barcelona 2010.
11. "A new method to employ the principle of maximum entropy to retrieve the risk neutral density", 3rd International Conference of Computational and Financial Econometrics, Cyprus 2009.
12. "A new method to employ the principle of maximum entropy to retrieve the risk neutral density", 16th Annual Conference of the Multinational Finance Society, Crete 2009.
13. "A new method to employ the principle of maximum entropy to retrieve the risk neutral density", 9th Hellenic European Conference on Computational Mathematics and its Applications, Athens 2009.
14. Discussion of the paper "The aggregate price impact of the disposition effect" (by Choe and Eom), 35th European Finance Association Annual Meeting, Athens 2008.
15. "A new method to employ the principle of maximum entropy to retrieve the risk neutral density", 2008 Annual Meeting of the European Financial Management Association, Athens 2008.
16. "Forecasting the mean and volatility of stock returns from option prices" (with Elias Tzavalis), 5th Conference on Research on Economics Theory and Econometrics, Crete 2006.
17. "Gram-Charlier series expansion of risk neutral densities" (with Elias Tzavalis), 4th Conference of the Hellenic Finance and Accounting Association, Piraeus 2005.
18. "Option pricing based on a general equilibrium model with regime shifts" (with Kyriakos Chourdakis and Elias Tzavalis), International Conference of Computational Methods in Sciences and Engineering, Loutraki 2005.
19. "Estimating Risk Neutral Densities of Asset Prices based on Risk Neutral Moments: An Edgeworth Expansion Approach" (with Elias Tzavalis), International Conference of Computational Methods in Sciences and Engineering, Athens 2004.
20. "The evaluation of assets and derivatives using non-parametric methods and characteristic functions" (with Elias Tzavalis), 2004 Annual Meeting of the European Financial Management Association, Basel 2004.

21. “Non-parametric estimation of state-price densities using characteristic functions and option prices” (with Elias Tzavalis), Second Conference on Research on Economics Theory and Econometrics, Crete 2003.

6.8. ΠΑΡΟΥΣΙΑΣΕΙΣ ΕΡΓΑΣΙΩΝ ΣΕ ΕΠΙΣΤΗΜΟΝΙΚΑ ΣΕΜΙΝΑΡΙΑ:

1. Recovering the market risk premium from stock and option prices (with George Chalamandaris):
 - Τμήμα Τραπεζικής και Χρηματοοικονομικής, Πανεπιστήμιο Πειραιά, 2015.
 - Manchester Business School, 2014.
2. Put-call parity violations and return predictability: Evidence from the 2008 short sale ban (with George Nishiotis):
 - Schulich Business School, York University, 2011 (παρουσίαση από τον συν-συγγραφέα).
 - Τμήμα Λογιστικής και Χρηματοοικονομικής, Οικονομικό Πανεπιστήμιο Αθηνών, 2011.
 - Τμήμα Δημόσιας Διοίκησης και Διοίκησης Επιχειρήσεων, Πανεπιστήμιο Κύπρου, 2011 (παρουσίαση από τον συν-συγγραφέα).
3. Retrieving risk neutral densities from European option prices based on the principle of maximum entropy:
 - Τμήμα Δημόσιας Διοίκησης και Διοίκησης Επιχειρήσεων, Πανεπιστήμιο Κύπρου, 2008.
 - Τμήμα Τραπεζικής και Χρηματοοικονομικής, Πανεπιστήμιο Πειραιά, 2008.
4. Risk premium effects on implied volatility regressions (with Elias Tzavalis):
 - Τμήμα Λογιστικής και Χρηματοοικονομικής, Οικονομικό Πανεπιστήμιο Αθηνών, 2008.
 - Τμήμα Οικονομικών, Πανεπιστήμιο Κρήτης, 2008.
 - Τμήμα Οικονομικών, Πανεπιστήμιο Κύπρου, 2007.

6.9. ΣΥΜΜΕΤΟΧΗ ΣΕ ΕΡΕΥΝΗΤΙΚΑ ΠΡΟΓΡΑΜΜΑΤΑ:

1. Ανάθεση Έρευνας από την Τράπεζα της Ελλάδος, 2015 – 2016. **Τίτλος:** Η αποτελεσματικότητα της μη συμβατικής νομισματικής πολιτικής στη μεταβλητότητα και η αστάθεια κινδύνου μεταβλητότητας.
2. Δράση 1 για την ενίσχυση νέων μελών ΔΕΠ του ΟΠΑ, 2015 – 2016. **Τίτλος:** Ex-ante estimates of market risk premium implied from option prices.
3. Επιχειρησιακό Πρόγραμμα «Εκπαίδευση και Δια Βίου Μάθηση», Δράση Αριστεία II, 2014 – 2015. **Τίτλος:** Μεγάλα Σοκ, δομικές αλλαγές και μακροοικονομικές σχέσεις.

6.10. ΚΡΙΤΗΣ ΣΕ ΕΠΙΣΤΗΜΟΝΙΚΑ ΠΕΡΙΟΔΙΚΑ:

Management Science, Quantitative Finance, Journal of Business and Economic Statistics, Asia Pacific Management Review, International Review of Economics and Finance, Journal of Empirical Finance, Journal of Financial Research, Journal of Banking and Finance, Computational Economics, International Journal of Economic Sciences and Applied Research.

7. ΔΙΔΑΚΤΙΚΗ ΕΜΠΕΙΡΙΑ

7.1. ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΟ ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΑΘΗΝΩΝ

Προπτυχιακά μαθήματα:

1. *Εισαγωγή στην Οικονομετρία* (Εαρινό 2014, 2015)
2. *Μαθηματικά Χρηματοπιστωτικής Ανάλυσης* (Χειμερινό 2010 – 2016)
3. *Derivatives Markets*, Πρόγραμμα ERASMUS (Εαρινό 2010 – 2013)
4. Φροντιστηριακές διαλέξεις στο μάθημα “*Χρηματοοικονομική Οικονομετρία*” (Χειμερινό 2002)

Μεταπτυχιακά μαθήματα:

1. *Ποσοτικές μέθοδοι στη Χρηματοοικονομική (προπαρασκευαστικό)*, ΜΠΣ στη Λογιστική και Χρηματοοικονομική (Χειμερινό 2010 – 2016)
2. *Ποσοτικές μέθοδοι στη Λογιστική (προπαρασκευαστικό)*, ΜΠΣ στη Λογιστική και Χρηματοοικονομική (Χειμερινό 2010 – 2016)

3. *Εισαγωγή στη Χρηματοοικονομική (προπαρασκευαστικό)*, ΜΠΣ στη Λογιστική και Χρηματοοικονομική (Χειμερινό 2016)
4. *Ποσοτικές μέθοδοι στη Λογιστική*, ΜΠΣ στη Λογιστική και Χρηματοοικονομική (Χειμερινό 2010 – 2013)
5. *Financial Management*, ΜΠΣ στη Λογιστική και Χρηματοοικονομική (Αγγλόφωνο) (Χειμερινό 2011 – 2014) και ΜΠΣ Διεθνούς Ναυτιλίας, Χρηματοοικονομικής και Διοίκησης (Αγγλόφωνο) (Χειμερινό 2015, 2016)
6. *Υπολογιστική Χρηματοοικονομική*, ΜΠΣ στη Λογιστική και Χρηματοοικονομική (Εαρινό 2010 – 2016)
7. *Χρηματοοικονομική Οικονομετρία*, ΜΠΣ στη Λογιστική και Χρηματοοικονομική (Χειμερινό 2014, 2016)
8. Φροντιστηριακές διαλέξεις στο μάθημα “*Επενδύσεις Χαρτοφυλακίου*”, ΜΠΣ στην Εφαρμοσμένη Οικονομική και Χρηματοοικονομική (Χειμερινό 2003 - 2004, Εαρινό 2005)

Διπλωματικές εργασίες: Επίβλεψη διπλωματικών εργασιών για το ΜΠΣ στη Λογιστική και Χρηματοοικονομική και το ΜΠΣ Διεθνούς Ναυτιλίας, Χρηματοοικονομικής και Διοίκησης.

7.2. ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΚΥΠΡΟΥ

Προπτυχιακά μαθήματα:

1. *Χρηματοοικονομική Διοίκηση Επιχειρήσεων II* (Χειμερινό 2006 - 2009)
2. *Χρηματοοικονομική Διοίκηση Επιχειρήσεων I* (Εαρινό 2007, 2008)

Μεταπτυχιακά μαθήματα:

1. *Χρηματοοικονομική Θεωρία*, ΜΠΣ στην Χρηματοοικονομική (Χειμερινό 2007)
2. *Προαιρετικά Δικαιώματα και Προθεσμιακά Συμβόλαια*, ΜΠΣ στην Χρηματοοικονομική (Χειμερινό 2008, 2009)

7.3. ΕΘΝΙΚΟ ΜΕΤΣΟΒΙΟ ΠΟΛΥΤΕΧΝΕΙΟ

Μεταπτυχιακά μαθήματα:

1. *Αρχές Οικονομετρίας*, ΜΠΣ Μαθηματικής Προτυποποίησης στις Σύγχρονες Τεχνολογίες και την Οικονομία (Εαρινό 2004 – 2006, 2010)

2. *Προχωρημένη Χρηματοοικονομική Θεωρία*, ΜΠΣ Μαθηματικής Προτυποποίησης στις Σύγχρονες Τεχνολογίες και την Οικονομία (Χειμερινό 2004, 2005)
3. “*Retrieving Risk Neutral Densities from Option Prices*”, 1ο Θερινό Σχολείο Μαθηματικής Προτυποποίησης, Εθνικό Μετσόβιο Πολυτεχνείο.

Διπλωματικές εργασίες:

Επίβλεψη διπλωματικών εργασιών για το ΜΠΣ Μαθηματικής Προτυποποίησης στις Σύγχρονες Τεχνολογίες και την Οικονομία.

8. ΥΠΟΤΡΟΦΙΕΣ

ΣΕΠΤΕΜΒΡΙΟΣ 2002 – ΣΕΠΤΕΜΒΡΙΟΣ 2005: Υποτροφία Ηράκλειτος, Υπουργείο Εθνικής Παιδείας και Θρησκευμάτων, ΕΠΕΑΕΚ II.