

## PUBBLICAZIONI

1. Bayesian Inference on Dynamic Models with Latent Factors, in G.L. Mazzi e G. Savio, *Growth and Cycle in the Eurozone*, Ed. Palgrave Macmillan, 2007, pp. 25-44 (co-authors: M. Billio, R. Casarin)
2. Performance, Style and Persistence of Italian Equity Funds, forthcoming *The European Journal of Finance*, 2005 (co-authors: R. Casarin, M. Lazzarin)
3. Stochastic Volatility Model, in *Quantitative Methods for Trading and Investment*, ed. C. Dunis e J. Laws, John Wiley, 2003 (co-author: M. Billio)
4. La copertura dei rischi finanziari nelle imprese italiane attraverso gli strumenti derivati. *Moneta e Credito*, 56/217, 55-75, 2002 (co-authors: G. Bison, L. Pelizzon)
5. Dollar/Euro Exchange Rate: A Monthly Econometric Model for Forecasting, *The European Journal of Finance*, Vol. 8, n. 4, 2002 (co-authors: L. Trevisan, M. Trova, F. Volo)
6. The EURO - What's in the Future?, Preface to the Special Issue of *The European Journal of Finance*, Vol. 8, n. 4, 2002 (co-author: M. Esposito)
7. La Style Analysis nel mercato azionario italiano, *Rivista Italiana degli Economisti*, V, 3, 2000 (co-authors: L. Pelizzon, T. Grava)
8. Combining forecasts: some results on exchange and interest rates, *The European Journal of Finance*, 6, 2, 2000 (co-authors: M. Billio e C. Toffano)
9. Investment Styles in the European Equity Market, in C. Dunis (a cura di), *Advances in Quantitative Asset Management*, Kluwer Academic P., Dordrecht, 2000 (co-authors: M. Billio, R. Casarin, C. Méhu)
10. Modelli neurali artificiali geneticamente evoluti per trading system su strumenti derivati, *Amministrazione e Finanza*, n.23, IPSOA, Milano, 1999 (co-authors: L. Tiozzo C., M. Billio)
11. L'analisi tecnica e la previsione econometrica, in D. Sartore (ed.), *Gli strumenti derivati*, IPSOA, Milan, 1999. (Co-author: L. Cappellina)
12. La combinazione di previsioni, in D. Sartore (ed.), *Gli strumenti derivati*, IPSOA, Milan, 1999. (co-author: M. Billio)
13. L'analisi tecnica e i modelli "GARCH", in D. Sartore (ed.), *Gli strumenti derivati*, IPSOA, Milan, 1999. (co-author: D. Dalan)
14. Opportunità di arbitraggio nel mercato del BTP Future: Una verifica empirica, in D. Sartore (ed.), *Gli strumenti derivati*, IPSOA, Milan, 1999. (co-authors: A. Giacomelli and M. Trova)
15. The Promotion of Economic Activity: Intervention and Development Models, in Barbara Gobbo and Alessandro Giolai (eds.), *The Transformation Process in Serbia: Critical Factors and Development Opportunities*, FINEST, Udine, 1998. (co-author: P. Fasulo)
16. Financial Optimisation in the New Independent States Financial Institution", Final Report for the European Commission – DG II, Brussels, 1997 (co-authors: M. Billio, M. Corazza and L. Pelizzon)
17. I flussi finanziari nei mercati dell'Euro, *Amministrazione e Finanza Oro*, n. 4 bis, 31 December 1997. (co-authors: M. Iannacone and C. Scardovi)
18. Preface of *Manuale di Risk Management: metodologie e tecniche per una gestione strategica nella banca*, Edibank, Rome, 1997.
19. Cicli e cambiamenti di regime negli indici azionari italiani, *Quaderni di Statistica e Matematica Applicata alle Scienze economico-sociali*, Università di Trento, Vol XVII, n. 1-2-3, 1997. (co-authors: M. Billio and L. Cappellina)
20. A Time-Varying Parameter Model for the Mark-Dollar Exchange Rates, *FFM96 Conference Proceedings*, London, May, 1996.
21. Econometria - in T. Cozzi, S. Lombardini and M. Salvati (eds.), *Economia 1970-1990*, Edizioni della Fondazione G. Agnelli, Torino, 1995.
22. Analisi statistica e proiezione dinamica di alcuni aggregati creditizi: utilità operativa nella gestione bancaria, *Bancaria*, Mensile dell'ABI, Anno 49, N. 2, 1993. (co-authors: P. Diprima and L. Pelizzon)
23. ICARO 1.0: un modello econometrico trimestrale dell'economia italiana con aspettative forward-looking: 1970-1989. Alcuni risultati preliminari, *Ricerche applicate e modelli per la politica economica*, Banca d'Italia, 1991. (co-author: S. Calliari)

24. Un modello a parametri variabili per il tasso di cambio marco-dollaro - Ricerche applicate e modelli per la politica economica, Banca d'Italia, 1991.
25. Alcuni problemi di specificazione e stima di modelli a parametri variabili multivariati, in M. Faliva (ed.), *Il ruolo dell'econometria nell'ambito delle scienze economiche*, Il Mulino, Bologna, 1991. (co-author: C. Carraro)
26. Strumenti ed obiettivi intermedi della politica monetaria in Italia: esperimenti di controllo con un modello mensile del mercato monetario e degli impieghi bancari, in C. Carraro (ed.), *Politica Economica e Teoria del Controllo*, Cafoscarina editrice, 1989, Venezia, 289-318. (co-authors: C. Carraro and S. Calliari)
27. "Erratic Managed But Still ... An Econometric Analysis" - Discussion of the R.G. Avesani and G.M. Gallo paper, in R.G. Avesani, F. Spinelli, R. Tamborrino (eds.), *Moneta e cambi. Aspetti storici, teorici ed empirici*, Banca Di Trento e Bolzano, 1989.
28. La validità empirica della teoria neoclassica della domanda: una verifica con i dati italiani 1960-1983 - *Rivista Internazionale di Scienze Economiche e Commerciali*, Vol. 35 (1988), n. 4-5, 313-344. (co-author: S. Calliari)
29. Square Root Iterative Kalman Filter: Theory and Applications to Regression Models, *Annales d'economie et de statistique*, 6/7, INSEE, Paris, 1987. (co-author: C. Carraro)
30. Some Remarks on the Causality Definitions in the Non-linear Theory of Stochastic Process, *Statistica*, 2, 1987.
31. *Developments of Control Theory for Economic Analysis*, Kluwer Academic Publishers, Dordrecht, The Netherlands, 1987. (curatore con: C. Carraro)
32. Intermediate Targets and Instruments of Monetary Policy, *Journal of Economic Dynamics and Control*, 10, 1986. (co-authors: C. Carraro and S. Calliari)
33. Un modello "monetarista" dell'economia italiana: alcuni risultati preliminari, *Ricerche Economiche*, n. 3, 1983. (co-author: S. Calliari)
34. Il concetto di causalità in econometria, in M.C. Galavotti and G. Gambetta (eds.), *Causalità e modelli probabilistici*, CLUEB, Bologna, 1983. (co-author: G. Gambetta)
35. Identificazione, causalità ed esogeneità: alcune osservazioni critiche, in D. Piccolo (ed.), *Analisi moderna delle serie storiche*, Franco Angeli, Milan, 1983.
36. Le relazioni di causalità tra moneta, attività economica e prezzi: alcuni tests con i dati generati dall'economia italiana nel periodo 1962.01 - 1979.04, *Ricerche Economiche*, n. 1-2 e n. 3-4, 1980. (co-author: S. Calliari)