

Elisa Luciano

Other Publications

Books

- *Matematica per la gestione finanziaria*, with L. Peccati, Ed. Riuniti, 1997.

Papers published in refereed journals and proceedings

1. Investment gain e mortality gain da riserve stocastiche negli attuali scenari di mercato, in cooperation with E. Vigna, Giornata Annuale degli Attuari Torinesi, Torino, December 2003, invited speech, in press.
2. Rischio di mortalità e di tasso di interesse nelle polizze vita: alcune considerazioni, in cooperation with E. Vigna, Giornata Annuale degli Attuari Torinesi, Torino, December 2002, invited speech, in press.
3. Un'introduzione al Valore a rischio, *Rendiconti della Giornata Annuale degli Attuari Torinesi*, Torino, December 2001.
4. Fulfillment of Regulatory Requirements on VAR and Optimal Portfolio Policies, invited presentation at EURO XV-INFORMS XXXIV, Barcellona, July 1997, presented at XXI Meeting of the Euro Working Group, Venezia, October 1997 and at XXV Meeting of the European Finance Association, Parigi, August 1998, *Rivista Internazionale di Scienze Economiche e Commerciali*, XLVII, 4, December 2000, pp.579-601.
5. Swap pricing and hedging of general DCFs, *Rivista di Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali*, XXI, 1998, pp.73-95.
6. NPVs as swaps, *Proceedings of the XXII AMASES Meeting*, September 1998
7. Value at Risk for Inventory Models, *Proceedings of the X International Symposium on Inventories*, Budapest, August 1998.
8. A Note on the Pricing Solution to Bilateral Monopoly and its Efficiency, in cooperation with L. Peccati, *Rivista Internazionale di Scienze Economiche e Commerciali*, XLV (3), 1998, pp. 443-62
9. Optimal Design of Premium Schedules in a Bilateral Setting, in *Proceedings of the International Congress of Actuaries*, Birmingham, 1998.
10. Optimal Design of Premium Schedules in a Bilateral Setting (complete version), *Quaderni del Dipartimento di Statistica e Matematica Applicata dell'Università di Torino*, 4, September 1997
11. Loadings and Deductibles: can a vicious circle arise? (complete version), *Quaderni del Dipartimento di Statistica e Matematica Applicata dell'Università di Torino*, 3, September 1997
12. Accordi di fornitura in alternativa alla compartecipazione agli utili: un caso concreto, *Rendiconti per gli Studi Economici Quantitativi (già Rendiconti del Comitato per gli Studi Economici)*, Ca' Foscari, Venice, 1996, pp. 153-169
13. On Optimal Insurance Arrangements, in cooperation with L. Peccati, *Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari*, 59, 1996, pp. 27-37
14. Funzioni di Green per equazioni differenziali ordinarie e applicazioni in Finanza, *Rivista di Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali*, 18 (2), 1996, pp. 199-227
15. Bonds Yield in thin markets, in cooperation with L. Peccati, *Rendiconti del Comitato per gli Studi Economici*, Ca' Foscari, Venice, 29, 1991, pp. 107-115
16. A note on option pricing with stochastic interest rate, spot yield and volatilities, *Quaderni dell'Istituto di Matematica Finanziaria dell'Università di Torino*, III (65), 1992

17. Inferenza Bayesiana sui coefficienti Beta, in cooperation with L. Peccati, *Proceedings of the XV AMASES Meeting*, September 1991, pp. 353-67
18. Equilibrium in a financial market with asymmetric information, imitation and noise, in Some Models of Imperfect Financial Markets, *Quaderni dell'Istituto di Matematica Finanziaria dell'Università di Torino*, III (62), 1991
19. La leva finanziaria multiperiodale, in cooperation with L. Peccati, *Finanza, Imprese e mercati*, 2 (3), 1990, pp.345-62
20. VAN e risultati di periodo in condizioni di incertezza, in cooperation with L. Peccati, in *Scritti in omaggio a L. Daboni*, Lint, Trieste, 1990, pp.183-98
21. A new perspective on dynamic portfolio choices, *Rivista di Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali*, 12 (1), 1990, pp. 91-106
22. Rovina, Assicurazione e Scambi di Attività Finanziarie, *Rivista di Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali*, 11 (1,2), 1989, pp. 69-94
23. Sulla dinamica dell'allocazione della ricchezza, *Rivista di Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali*, 11 (1,2), 1989, pp. 41-62
24. Sugli effetti dei costi di transazione nelle scelte di portafoglio con orizzonte finito, *Rivista Internazionale di Scienze Sociali*, 97(2), 1989, pp.254-71
25. Bid-ask Portfolio Choice and Option Pricing, in cooperation with B. Dumas, *Financial Markets Developments and Reforms*, Foundation HEC, vol. D, 1988
26. Un modello di affidamento in condizioni di incertezza, *Giornale degli Economisti e Annali di Economia*, 45 (9-10), 1986, pp. 527-44