

# Curriculum Vitae

## Informazioni personali

Nome e Cognome: Mauro Costantini

Indirizzo: Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università dell'Aquila, L'Aquila, Italia

Email: mauro.costantini@univaq.it

Nazionalità: Italiana

## Esperienza lavorativa

1/10/2022- Professore Ordinario di Statistica, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università dell'Aquila, L'Aquila, Italia

1/04/2021-30/09/2022 Professore Ordinario di Statistica Economica, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università dell'Aquila, L'Aquila, Italia

1/10/2018-31/03/2021 Professore Associato di Statistica Economica, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università dell'Aquila, L'Aquila, Italia

1/8/2012-Settembre 2018 Professore Associato di Economia, Dipartimento di Economia e Finanza, Brunel University London, Londra, Inghilterra

1/7/2011-31/7/2012 Ricercatore di Economia, Dipartimento di Economia e Finanza, Brunel University London, Londra, Inghilterra

1/9/2008-1/6/2011 Ricercatore di Economia, Dipartimento di Economia,

Università di Vienna, Vienna, Austria

2005-2008 Assegno di Ricerca, ISAE, Istituto Studi e Analisi Economica, Area di Ricerca: Modelli di previsione, Piazza dell'Indipendenza, 4, 00185, Roma, Italia

2002-2004 Assegno di Ricerca, Area di ricerca: Modelli econometrici della crescita per dati cross-section e longitudinali, Dipartimento di Economia Teorica e Metodi Quantitativi, Università di Roma, "La Sapienza", Roma, Italia.

## **Formazione**

2003 (20/03) Dottorato di ricerca in 'Analisi economica, matematica e statistica dei fenomeni sociali'. Titolo della tesi. "Un'analisi di trend e cicli comuni della disoccupazione nell'Unione Economica e Monetaria", Supervisore Prof. F. Giusti, Università di Roma "La Sapienza", Roma, Italia

1996 Laurea, Scienze Politiche, Indirizzo Politico Economico. Votazione: 110/110 e lode, Università di Roma "La Sapienza", Roma, Italia.

## **Riconoscimenti universitari**

Vincitore del premio "Student Led Teaching Awards", Brunel University London, Londra, Inghilterra, 2015.

## **Corsi frequentati**

2008 "Monte Carlo methods and bootstrap", ISAE, Prof. S. Fachin

2001 (15-17/11) Scuola di Econometria "Time Series Analysis: Arima Models, Cointegration and Stochastic Volatility", Greta Associati and Università di Venezia Cà Foscari, Venezia, Italia

2000-2001 "Statistica, Probabilità, Processi Stocastici, Inferenza Statistica, Statistica Nonparametrica, Econometria delle series storiche, Econometria dei dati panel, Metodi di simulazione", Master in Metodi Quantitativi, Università of Rome, Tor Vergata, Roma, Italia

2000 (5-16/6) Scuola di Econometria, CIDE (Centro Interuniversitario di Econometria), Bertinoro, Forlì, Italia

2000 (19-22/9) Scuola estiva di Statistica and Econometria “Non-linear Time Series: Theory and Applications”, Scuola Italiana di Statistica, Salerno, Italia

1998-1999 Scuola di Economia “Credit risk and Monetary Economics”, Dipartimento di Economia Pubblica, Università di Roma, “La Sapienza”, Roma, Italia.

## **Attività didattica**

### **Laurea Triennale**

2021-2022 Statistica, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

2020-2021 Statistica, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

2019-2020 Statistica, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

2018-2019 Statistica, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

2014-2018 Gestione del Rischio (modelli empirici per la finanza), Dipartimento di Economia e Finanza, Brunel University London, Londra, Inghilterra

2012-2018 Econometria, Dipartimento di Economia e Finanza, Brunel University London, Londra, Inghilterra

2012-2014 Statistica per l'Economia e la Finanza, Scuola di Studi Sociali, Dipartimento di Economia e Finanza, Brunel University London, Londra, Inghilterra

2008-2011 Introduzione all'Econometria, Università di Vienna, Facoltà di Economia, Vienna, Austria.

## **Laurea Magistrale**

2021-2022 Statistics for Business and Economics, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

2020-2021 Statistics for Business and Economics, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

2019-2020 Statistics for Business and Economics, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

2018-2019 Statistica per l'Economia e la Finanza, Dipatimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia.

## **Master**

2011-2012 Introduzione ai Metodi Quantitativi, Master in Economia e Finanza, Scuola di Studi Sociali, Dipartimento di Economia e Finanza, Brunel University, Londra, Inghilterra

2009-2011 Modelli panel per dati non stazionari, Master in Economia, Università di Vienna, Facoltà di Economia, Vienna, Austria

2008-2011 Previsioni di serie storiche, Master in Econometria Applicata, Scuola Superiore di Economia e Finanza, Roma, Italia

2007-2011 Modelli panel per dati non stazionari, Master in Econometria Applicata, Scuola Superiore di Economia e Finanza, Roma, Italia

2003 Modelli per dati ad alta frequenza, Master in Economia and Finanza, Coordinatore Prof. G. Szego, Ernest & Young School, Roma, Italia.

## **Percorso di Eccellenza in Economia ed Econometria Spaziale**

2022-2023 Statistica avanzata con Matlab, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

2021-2022 Statistica avanzata con Matlab, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

2020-2021 Statistica avanzata con Matlab, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

2019-2020 Statistica con Matlab, Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

2018-2019 Introduzione a Matlab e Stata (Statistica), Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia

## **Professore ospite**

11/2019-1/2020 Attività di ricerca, Southampton Business School, Università di Southampton, Inghilterra.

## **Attività editoriale**

2020- Editore Associato, Empirical Economics

2020- Editore Associato, Forecasting.

## **Progetti finanziati**

“Forecasting returns in the foreign exchange market using macroeconomic models”, Banca Centrale d'Austria, Gennaio 2013-Dicembre 2014, 90.000 *Euro* Euro.

## **Studenti ospiti**

1/10/2019-9/12/2019 Eirini Bersimi (Research Student, Kent Business School, Università di Kent, Inghilterra), Dipartimento di Ingegneria Industriale e dell'Informazione e di Economia, Università dell'Aquila, L'Aquila, Italia.

## **Supervisione studenti di dottorato**

O. Baltodano, 2023 (co-supervisione con R. Cossarin), Università Ca' Foscari, Venezia, Italia

Habiba Al, completato 2016, Brunel University London, Londra, Inghilterra

Francis Atsu, completato 2016, Brunel University London, Londra, Inghilterra

Clarisse Wuttidma, completato 2015, Brunel University London, Londra, Inghilterra.

## **Supervisione studenti Master**

Chinnanon, C., Hou, C., Hua, H., Jim-Agbagbue, C., Khan, A., Marfo, E., Ren, F., Yu, T., Zhang, C., Zhang, X., 2015, Southampton Business School, University of Southampton, Southampton, Inghilterra

Kassenov, O., Pavly, V., Saulyte, G., Xia, K., 2014-2015, Brunel University, Londra, Inghilterra.

## **Esaminatore esterno di dottorato**

2017 PhD in Management, University of Surrey, Surrey, Inghilterra

2017 PhD in Economics, Cardiff University, Cardiff, Galles

2015 PhD in Economics, Cardiff University, Cardiff, Galles

2015 PhD in Finance, University of Surrey, Surrey, Inghilterra.

## **Incarichi ed attività istituzionali**

2022 Membro Commissione esaminatrice Percorso di Eccellenza  
2021 Membro Commissione esaminatrice Percorso di Eccellenza  
2021 Membro Commissione Elezioni Presidenti CAD  
2020 Stakeholder report, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italy  
2019-2020 collaborazione con Osservatorio statistico di Ateneo, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia  
2019 Contributo all'analisi statistica dei dati relativi all'istruzione per il rapporto di sostenibilità, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italia  
2019: Presidente di Seggio, Elezioni Studentesche, Università degli Studi dell'Aquila, L'Aquila, Italy  
2017-2018 Exam convenor, Brunel University London, Londra, Inghilterra  
2016-2017 Exam convenor and GTA coordinator, Brunel University London, Londra, Inghilterra  
2015-2016 Team Leader Mitigating Circumstances, Brunel University London, Londra, Inghilterra  
2014-2015 Senior Tutor, Brunel University London, Londra, Inghilterra  
2012-2014 PhD Admission, Brunel University, Londra, Inghilterra  
2011-2012 MSc/MRes Convenor, Brunel University, Londra, Inghilterra.

## **Consulenze ed altre esperienze di lavoro**

2005 Ministero del Lavoro, Progetto di Lavoro: "L'impatto economico dei trasferimenti sociali ai comuni italiani", Roma, Italia  
2002-2003 MURST 2000, Progetto di Ricerca: "Alcuni aspetti delle relazioni tra evoluzione demografica e sviluppo economico e sociale", Coordinatore Prof. Marcello Natale, Dipartimento di Demografia, Università di Roma, "La Sapienza", Roma, Italia.

## Publicazioni

1. “Bayesian nonparametric panel Markov-switching GARCH models”, con R. Casarin and A. Osuntuyi, *Journal of Business & Economic Statistics*, 2023, di prossima pubblicazione
2. “A comparative study on p value combination tests for the panel unit root hypothesis”, with Claudio Lupi *Communications in Statistics - Simulation and Computation*, 2023, di prossima pubblicazione
3. “Estimating uncertainty spillover effects across euro area using a regime dependent VAR model”, with G. Angelini and J. Easaw, *Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics*, 1-23, 2022
4. “What Uncertainty Does to Euro Area Sovereign Bond Markets: Flight to Safety and Flight to Quality”, with R. Sousa, *Journal of International Money and Finance*, 122, 102574, 2022
5. “On the role of dependence in sticky price and sticky information Phillips curve: Modelling and forecasting”, con R. Casarin and A. Paradiso, *Economic modelling*, 105644, 2021
6. “On using predictive-ability tests in the selection of time-series prediction models: A Monte Carlo evaluation”, con R. Kunst, *International Journal of Forecasting*, 445-460,37,2021
7. “Consumption, asset wealth, equity premium, term spread and flight to quality”, con R. Sousa, *European Financial Management*, 778-807, 26, 2020
8. “Panel stationary tests against changes in persistence”, con R. Cerqueti, L. Gutierrez, and J. Westerlund, *Statistical papers*, 60, 1079-1100, 2019
9. “What do panel data say on inequality and GDP? New evidence at US state-level con A. Paradiso, *Economics Letters*, 168, 115-117, 2018



10. “Do inequality, unemployment, and deterrence affect crime over the long run”, con I. Meco e A. Paradiso, *Regional Studies*, 52, 558-571, 2018
11. “Forecast combinations in a DSGE-VAR lab”, con Ulrich Gunter and R. Kunst, *Journal of forecasting*, 36, 305–324, 2017
12. “A Simple Testing Procedure for Unit Root and Model Specification”, con A. Sen, *Computational Statistics and Data Analysis*, 102, 37-54, 2016
13. “Forecasting errors, directional accuracy and profitability of currency trading: The case of EUR/USD exchange rate, con J. Crespo Cuaresma e J. Hlouskova, *Journal of Forecasting*, 35, 652-668, 2016
14. “Identifying Stationary Series in Panels: A Monte Carlo Evaluation of Sequential Panel Selection Methods”, con C. Lupi, *Economics Letters*, 130, 9-14, 2016
15. “How accurate are the professional forecasts in Asia. Evidence from ten countries”, con Q. Chen e B. Deschamps, *International Journal of Forecasting*, 32, 154-167, 2016
16. “Housing wealth, Financial wealth, and consumption: new evidence for Italy and the UK”, con R. Barrell e I. Meco, *International Review of Financial Analysis*, 42, 316-323, 2015
17. “Small-Sample Improved Seasonal Unit Root Tests for Trending and Breaking Series”, con P.K. Narayan, S. Popp e J. Westerlund, *Communications in Statistics - Simulation and Computation*, 44, 868-877, 2015
18. “Determinants of Sovereign Bond Yield Spreads in the EMU. An Optimal Currency Area Perspective”, con M. Frassetto e G. Melina, *European Economic Review*, 70, 337-349, 2014

19. “On the usefulness of cross-validation for directional forecast evaluation”, con C. Bergmeir e J. M. Benítez, *Computational Statistics and Data Analysis*, 76, 132-143, 2014
20. “A Simple Panel-CADF Test for Unit Roots”, con C. Lupi, *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, 75, 276-296, 2013
21. “The role of monitoring of corruption in a simple endogenous growth model”, con R. Coppier e G. Piga, *Economic Inquiry*, 51, 1972-1985, 2013
22. “ Re-examining the Decline in the US Saving Rate: The Impact of Mortgage Equity Withdrawals”, con G. Caporale e A. Paradiso, *Journal of International Financial Markets, Institutions & Money*, 26, 215-225, 2013
23. “Forecasting industrial production using factor models and business survey data”, *Journal of Applied Statistics*, 40, 2275-2289, 2013
24. “Capital mobility and global factor shocks”, con L. Gutierrez, *Economic Letters*, 10, 513-515, 2013
25. “Financial Restraints and Private Investment: Evidence from a Non-stationary Panel”, con P. Demetriades, G. James e K. Lee, *Economic Inquiry*, 51, 1, 248-259, 2013
26. “New results on the convergence of random matrices”, with R. Cerqueti, *Statistics*, 4, 663-671, 2013
27. “Bootstrap innovational outlier unit root tests in dependent panels”, con L. Gutierrez, *Economics Letters*, 117, 817-819, 2012.
28. “On the Asymptotic Distribution of a Simple Test for Trending and Breaking Series”, con A. Sen, *Journal of Statistical Planning and Inference*, 142, 1690-1697, 2012

29. “New Evidence on the Convergence of International Income from a Group of 29 Countries”, con A. Sen, *Applied Economics Letters*, 19, 425-429, 2012
30. “A note on the asymptotic distribution of a perron-type innovational outlier unit root tests with a break”, con S. Popp, *Statistical Papers*, 52, 677-682, 2011
31. “Testing for rational bubbles in the presence of structural breaks: evidence from nonstationary panels”, con R. Cerqueti, *Journal of Banking and Finance*, 35, 2598-2605, 2011
32. “Combining forecasts based on multiple encompassing tests in a macroeconomic core system”, con R. Kunst, *Journal of Forecasting*, 30, 579-596, 2011
33. “A hierarchical procedure for the combination of forecasts”, con C. Pappalardo, *International Journal of Forecasting*, 26, 725-743, 2010
34. “Some nonparametric asymptotic results for a class of stochastic processes”, con R. Cerqueti, *Communications in Statistics - Theory and Methods*, 39, 2552-2560, 2010
35. “A panel cointegration approach to estimating substitution elasticities in consumption”, con M. Auteri, *Economic Modelling*, 27, 782-787, 2010
36. “Asymptotic solutions of a generalized eigenvalue problem”, con R. Cerqueti, *Applied Mathematical Sciences*, 3, 2985-2999, 2009
37. “Panel Cointegration and the Neutrality of Money”, con J. Westerlund, *Empirical Economics*, 36, 1-26, 2009
38. “Cointegration Analysis for Cross-sectionally Dependent Panels. The Case of Regional Production Functions”, con S. Destefanis, *Economic Modelling*, 26, 320-327, 2009

39. “On the Asymptotic Behavior of Random Matrices in a Multivariate Statistical Model”, con R. Cerqueti, *Statistics and Probability Letters*, 78, 2039-2045, 2008
40. “Simple Panel Unit Root Tests to Detect Changes in Persistence”, con L. Gutierrez, *Economics Letters*, 96, 363-368, 2007
41. “An Analysis of Inflation and Interest Rates. New Panel Unit Root Results in the Presence of Structural breaks” con C. Lupi, *Economics Letters*, 95, 408-414, 2007
42. “Co-movements and Correlations in International Stock Market”, con R. D’Ecclesia, *The European Journal of Finance*, 12, 567-582, 2006
43. “Divergence and Long-Run Equilibria in Italian Regional Unemployment Rates”, con C. Lupi, *Applied Economics letters*, 13, 899-904, 2006
44. “Testing the Stochastic Convergence of Italian Regions using panel data”, con G. Arbia, *Applied Economics letters*, 13, 775-783, 2006
45. “Stochastic convergence among European economies”, con C. Lupi, *Economics Bulletin*, 3, 1-17, 2005
46. “Fiscal Policy and Economic Growth: the Case of Italian Regions”, con M. Auteri, *The Review of Regional Studies*, 34, 72-93, 2004
47. “Is Social Protection a Necessity or Luxury good? New Multivariate Cointegration Panel Data Results”, con M. Auteri, *Applied Economics*, 36, 1887-1998, 2004.

## Proceedings

1. “A Characterization of the Dickey-Fuller Distribution With Some Extensions to the Multivariate Case” (with R. Cerqueti and C. Lupi), *American Statistical Association*, Business and Economic Statistics Section, 2009.

## Lavori risottoposti a riviste

“Bitcoin Market Networks and Cyberattacks”, con A. Maaitha, T. Mishra, and R. Sousa

## Lavori sottoposti a rivista

“On the performance of small scale DGSE models for directional forecast accuracy”, con G. Angelini

“Directional volatility Forecasting in the US Market”, con E. Bersimi e E. Panopoulou

## Lavori in corso

“A dynamic stochastic block model with degree correction and infinite communities”, con with O. Baltodano and R. Cossarin

“On the use of mean square error and directional forecast accuracy for model selection: a Monte Carlo investigation, con R. Kunst

## Lavori presentati a conferenze

2020 (19-2/12) “DGSE models with expectations correction and directional forecast accuracy, CFE conference (virtual)

2020 (29-30/10) “DGSE models with expectations correction and directional forecast accuracy, 2nd Vienna Workshop on Economic Forecasting

2019 (14-16/12) “DGSE model with expectations correction: Misspecification, forecasting errors and directional accuracy, CFE conference, Londra, Inghilterra

2018 (14-16/12) “DGSE model with expectations correction: Misspecification, forecasting errors and directional accuracy, CFE conference, Pisa, Italia

2014 (26-28/6) “Identifying I(0) Series in Macro-panels: Are Sequential Panel Selection Methods Useful? first annual meeting of the International Association for Applied Econometrics, Queen Mary, Londra, Inghilterra

2013 (14-16/12) “On the usefulness of cross-validation for directional forecast evaluation”, 7th CFE, Londra, Inghilterra

2013 (14-16/12) “Identifying I(0) Series in Macro-panels: Are Sequential Panel Selection Methods Useful?”, CFE , Londra, Inghilterra

2011 (25-29/8) “On the usefulness of the Diebold-Mariano test in the selection of predictions models: Some Monte Carlo evidence”, 65th European Meeting of the Econometric Society, Oslo, Norvegia

2010 (10-12/12) “On the usefulness of the Diebold-Mariano test in the selection of predictions models: Some Monte Carlo evidence”, 4th CSDA International Conference on Computational and Financial Econometrics, UCL, Inghilterra

2009 (28/3) “Combining forecasts based on multiple encompassing tests in a macroeconomic core system”, First Macroeconomic Forecasting Conference, Roma, Italia

2009 (28/3) “A Hierarchical procedure for the combination of forecasts”, First Macroeconomic Forecasting Conference, Roma, Italia

2009 (30-31/1) “A Panel-CADF Test for Unit Roots with an application to PPP”, Third Italian Congress of Econometrics and Empirical Economic, Ancona, Italia

2008 (22-25/6) “Combination of forecast methods using encompassing tests: An algorithm-based procedure”, International Symposium on Forecasting, ISF, Nizza, Francia

2008 (25-26/1) “Change in persistence tests for panels”, “Recent Developments in Econometric Methodology”, First International Conference in Memory of Carlo Giannini, Bergamo, Italia

2007 (23/2) “Nonparametric Fractional Cointegration Analysis, 2nd Tinbergen Institute Conference “20 Years of Cointegration: Theory and Practice in Prospect and Retrospect”, Rotterdam, Paesi Bassi

2007 (25/1) “Unit root and cointegration tests for cross-sectionally correlated panels. Estimating regional production functions”, Second Italian Congress

of Econometrics and Empirical Economics, Rimini, Italia

2007 (25/1) “Panel Cointegration and the Neutrality of Money”, Second Italian Congress of Econometrics and Empirical Economics, Rimini, Italia

2007 (25/1) “Nonparametric Fractional Cointegration Analysis”, Second Italian Congress of Econometrics and Empirical Economics, Rimini, Italia

2006 (2/9) “Panel Cointegration and the Neutrality of Money”, International conference for the management of risk factors in economically relevant human activities II, Università di Roma, “La Sapienza”, Italia

2005 (29-9/1-10) “Generalization of a nonparametric co-integration analysis for multivariate integrated process of an integer order”, Unit root and cointegration testing, International conference, Università di Algarve, Faro, Portogallo

2005 (16/9) “Intratemporal substitution and government spending: unit root and cointegration tests in a cross section correlated panel”, XVI Conferenza Scientifica della Società italiana di Economia Pubblica, Università di Pavia, Pavia, Italia

2005 (10/6) “Do European Economies Converge? A Nonstationary Panel Data Analysis”, First Workshop on Dynamic Econometrics, in memory of Carlo Giannini, Pavia, Italia

2004 (4/4) “A Correlation Among Stock Market Principal Component Analysis”, Conference on Computational Econometrics and Statistics”, Neuchâtel, Svizzera

2004 (3/4) “Testing the Stochastic Convergence of Italian Regions using panel data”, Conference on Computational Econometrics and Statistics”, Neuchâtel, Svizzera

2003 (7/7) “Co-movements and Correlation in International Stock Market”, International Forum of Operational Research, Bogazici University, Department of Industrial Engineering, Istanbul, Turchia.

## **Seminari**

2019 (11/12) “Uncertainty and spillover effects across the Euro Area”, Dipartimento di Economia, Università di Reading, Inghilterra

2016 (19/12) “Modelling corporate failure dependence of UK public listed firms”, Dipartimento di Economia, Università di Venezia Cà Foscari, Venezia, Italia

2016 (24/11) “Modelling corporate failure dependence of UK public listed firms”, Dipartimento di Statistica, Università di Bologna, Bologna, Italia

2012 (23/4) “The Feldstein-Horioka puzzle: common or idiosyncratic tales?”, Dipartimento di Economia, Università di Reading, Reading, Inghilterra

2012 (4/4) “The Feldstein-Horioka puzzle: common or idiosyncratic tales?”, Dipartimento di Istituzioni Pubbliche, Economia and Società, Università Roma Tre, Italia

2010 (30/3) “A panel cointegration approach to estimating substitution elasticities in consumption”, Dipartimento di Istituzioni Pubbliche, Economia and Società, Università Roma Tre, Italia

2008 (20/11) “A Panel-CADF Test for Unit Roots with an application to PPP”, Istituto di studi avanzati, Vienna, Austria

2008 (1/10) “Change in persistence tests for panels”, Dipartimento di Economia, Università Leicester, Leicester, Inghilterra

2008 (6/2) “Change in persistence tests for panels”, Università di Vienna, Dipartimento di Economia, Vienna, Austria

2007 (30/5) “Change in persistence tests for panels”, Università del Molise, Dipartimento SEGeS, Campobasso, Italia

2007 (30/5) “Detecting bubbles in stock market: new international evidence”, Dipartimento SEGeS, Università del Molise, Campobasso Italia

2006 (23/3) “Simple Panel Unit Root to Detect Changes in Persistence”, Dipartimento SEGeS, Università del Molise, Campobasso, Italia

2006 (16/3) “Simple Panel Unit Root to Detect Changes in Persistence”, Ente Einaudi, Roma, Italia

2005 (23/11) “Generalization of a nonparametric co-integration analysis for multivariate integrated process of an integer order”, Facoltà di Economia, Università di Venezia Ca’ Foscari, Venezia, Italia.



## **Attività di referaggio**

Annals of Operational Research, Annals of Regional Science, Applied Economics, Applied Economics Letters, Applied Financial Economics, American Journal of Economics and Sociology, Bulletin of Economic Research, Communications in Statistics–Simulation and Computation, Communications in Statistics–Theory and Methods, Computational Statistics and Data Analysis, Computational Economics, Economics Bulletin, Economic Inquiry, Economics Letters, Economic Modeling, Empirical Economics, Energy Journal, European Journal of Finance, European Journal of Operational Research, European Review of Agricultural Economics, Health Economic Review, Information Science, International Economics, International Journal of Approximate Reasoning, International Journal of Finance and Economics, International Journal of Forecasting, International Journal of Production Research, International Review of Economics and Finance, Italian Journal of Regional Science, Journal of Applied Statistics, Journal of Asian Economics, Journal of Banking & Finance, Journal of Corporate Finance, Journal of Economic Studies, Journal of Economics Dynamics and Control, Journal of Macroeconomics, Journal of Forecasting, Journal of the Royal Statistical Society, Journal of Statistical Software, Journal of Time Series Econometrics, Leverhulme Trust Grant, Manchester School, National Science Foundation, National Science Center, North American Journal of Economics and Finance, Oxford Bulletin of Economics and Statistics, Regional Science and Urban Economics, Regional Studies, Review of financial Economics, Review of Income and Wealth, Social Sciences and Humanities Research Council of Canada, Statistical Papers, Statistical Methods and Applications, Technological Forecasting & Social Change.

## **Principali interessi di ricerca**

Dati panel, Serie storiche, Previsioni, Finanza applicata.

## **Conoscenze informatiche**

Software: Word, Excel, Power Point, Latex

Pacchetti econometrici e statistici: Gauss, Matlab, Stata.

## **Lingue parlate**

Italiano: Madre lingua

Inglese: Fluente

Spagnolo: Fluente.