

# LIST OF PUBLICATIONS

Ermanno Pitacco

[ermanno.pitacco@econ.units.it](mailto:ermanno.pitacco@econ.units.it)

January, 2013

## Books

A. Olivieri, E. Pitacco (2011), *Introduction to Insurance Mathematics. Technical and Financial Features of Risk Transfers*, Springer

E. Pitacco, M. Denuit, S. Haberman, A. Olivieri (2009), *Modelling longevity dynamics for pensions and annuity business*, Oxford University Press

A. Olivieri, E. Pitacco (2008), *L'Assurance-Vie. Évaluer les contrats et les portefeuilles*, Pearson Education [Translation of: A. Olivieri, E. Pitacco (2005), *La valutazione nelle assicurazioni vita. Profili attuariali*, EGEA; translated by O. Le Courtois]

A. Olivieri, E. Pitacco (2005), *La valutazione nelle assicurazioni vita. Profili attuariali*, EGEA, Collana CERAP, Milano

E. Pitacco (2000), *Elementi di matematica delle assicurazioni*, LINT Editoriale, Trieste

E. Pitacco (2000), *Matematica e tecnica attuariale delle assicurazioni sulla durata di vita*, LINT Editoriale, Trieste

S. Haberman, E. Pitacco (1999), *Actuarial models for disability insurance*, Chapman & Hall / CRC Press, London

E. Pitacco, A. Olivieri (1997), *Introduzione alla teoria attuariale delle assicurazioni di persone*, Quaderni dell'Unione Matematica Italiana, No. 42, Pitagora Editrice, Bologna

E. Pitacco (1995), *Modelli attuariali per le assicurazioni sulla salute*, EGEA, Collana CERAP, Milano

E. Pitacco (1994), *Introduzione alla matematica attuariale*, LINT, Trieste

E. Pitacco (1992), *Lezioni di tecnica attuariale delle assicurazioni libere sulla vita* (3rd ed.), LINT, Trieste

E. Pitacco (1989), *Elementi di matematica attuariale delle assicurazioni sulla vita*, LINT, Trieste,

E. Pitacco (1989), *Lezioni di tecnica attuariale delle assicurazioni libere sulla vita* (2nd ed.), LINT, Trieste

E. Pitacco (1983), *Lezioni di tecnica attuariale delle assicurazioni libere sulla vita* (1st ed.), LINT, Trieste

E. Pitacco (1978), *Lezioni di Statistica Matematica*, Ed. Libreria Goliardica, Trieste

## Articles in scientific journals

A. Olivieri, E. Pitacco (2011), Life tables in actuarial models: from the deterministic setting to a Bayesian approach, *AStA Advances in Statistical Analysis*, <http://dx.doi.org/10.1007/s10182-011-0177-y>

D. Medved, A. Ahčan, J. Sambt, E. Pitacco (2011), Adoption of projected mortality table for the Slovenian market using the Poisson log-bilinear model to test the minimum standard for valuing life annuities, *EBR (Economic and Business Review)*, **13** (4): 251-272; available at: <http://www.ebrjournal.net/ojs/index.php/eb/article/view/83>

A.R. Bacinello, P. Millosovich, A. Olivieri, E. Pitacco (2011), Variable annuities: a unifying valuation approach, *Insurance: Mathematics & Economics*, **49**: 285-297

A. Olivieri, E. Pitacco (2009), Stochastic mortality: the impact on target capital, *ASTIN Bulletin*, **39** (2): 541-563

A. Olivieri, E. Pitacco (2009), Stochastic models for disability: Approximations and applications to sickness and personal accident insurance, *The ICFAI University Journal of Risk & Insurance*, **VI** (2): 19-43

A. Olivieri, E. Pitacco (2009), Capital allocation to meet mortality risks for life annuities, *ICFAI University Journal of Financial Risk Management*, **VI** (1): 36-54

A. Olivieri, E. Pitacco (2008), Solvency requirements for life annuities: some comparisons, *Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari*, **LXXI** (1-2): 59-82

A. Olivieri, E. Pitacco (2008), Assessing the cost of capital for longevity risk, *Insurance: Mathematics & Economics*, **42** (3): 1013-1021

E. Pitacco, A. Olivieri (2006), Stochastic mortality in life insurance, *Statistica Applicata (Italian Journal of Applied Statistics)*, **18** (4): 661-684

E. Pitacco (2004), From Halley to "frailty": a review of survival models for actuarial calculations, *Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari*, **LXVII** (1-2): 17-47

E. Pitacco (2004), Survival models in a dynamic context: a survey, *Insurance: Mathematics & Economics*, **35** (2): 279-298

A. Olivieri, E. Pitacco (2002), Managing demographic risks in Long Term Care insurance, *Rendiconti per gli Studi Economici Quantitativi*, **2** (2): 15-37

A. Olivieri, E. Pitacco (2003), Solvency requirements for pension annuities, *Journal of Pension Economics and Finance*, **2** (2): 127-157

E. Pitacco (2002), Le assicurazioni Long Term Care nel nuovo scenario demografico, *Assicurazioni*, **LXIX** (3-4): 409-429

A. Olivieri, E. Pitacco (2002), Premium systems for post-retirement sickness covers, *Belgian Actuarial Bulletin*, **2**: 15-25  
(<http://www.actuaweb.be/BAB/volume2/Vol2article3.pdf> )

E. Pitacco (2001), Technical management of health insurance (ASTIN 2000: Report on Topic 3), *Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari*, **LXIII** (2): 165-178

- A. Olivieri, E. Pitacco (2000), Safe-side requirements in life insurance: a corporate perspective, *Journal of Actuarial Practice*, **8** (1-2): 115-145
- E. Pitacco (1999), Multistate models for long-term care insurance and related indexing problems, *Applied stochastic models in business and industry*, **15**: 429-441
- E. Pitacco (1997), Teoria e tecnica attuariale dell'assicurazione vita: spunti per un'interpretazione dello "stato dell'arte", *Assicurazioni*, **LXIV** (1): 3-14
- F. Pietrobono, E. Pitacco (1996), The Third Life Directive: an actuarial perspective in the Italian framework, *Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari*, **LIX** (1-2): 117-136
- E. Pitacco (1995), Actuarial models for pricing disability benefits: towards a unifying approach, *Insurance: Mathematics & Economics*, **16** (1): 39-62
- E. Pitacco (1992), L'innovazione nel settore delle "assicurazioni sulla salute": le coperture PHI, DD, LTC, *Rivista di Diritto ed Economia dell'Assicurazione*, (2-3): 345-368
- E. Pitacco (1991), Una generalizzazione del modello inferenziale bayesiano "Poisson-gamma". Applicazioni in assicurazioni malattia, *Rivista di Matematica per le Scienze economiche e sociali*, **14** (1): 9-23
- E. Pitacco (1987), Bruno de Finetti e le macchine che pensano (e che fanno pensare), *Rivista IBM*, **XXIII** (1): 38-48
- E. Pitacco (1986), Margine di solvibilità e utile industriale nella gestione di un portafoglio di assicurazioni vita, *Rivista di Matematica per le Scienze economiche e sociali*, **9** (2): 129-142
- E. Pitacco, M. Prestamburgo (1986), Modelli di simulazione e scelte imprenditoriali in agricoltura, *Bollettino degli Interessi Sardi - Studi di Economia e Diritto*, **XXXV** (1)
- E. Pitacco (1984), L'adeguamento delle prestazioni nel ramo vita: modello attuariale ed esperienze estere, *Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari*, **XLVII** (1-2): 9-26
- L. Crisma, E. Pitacco (1982), Su due metodi simulativi per la valutazione di grandezze interessanti assicurazioni sulla vita, *Rivista di Matematica per le Scienze economiche e sociali*, **5** (1): 41-51
- E. Pitacco (1981), Sintesi del bilancio e valutazione comparata delle imprese d'assicurazione: problemi e prospettive, *Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari*, **XLIV** (1-2): 23-36
- E. Pitacco (1980), Modelli di simulazione e relative applicazioni attuariali, *Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari*, **XLIII** (2): 7-24
- E. Pitacco (1979), Alcuni approcci inferenziali per processi di arrivo dei sinistri, *Rivista di Matematica per le Scienze economiche e sociali*, **2** (2): 127-156
- E. Pitacco (1978), Un modello stocastico per la valutazione della politica di bonus-malus in RCA, *Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari*, **XLI** (1-2): 91-112

E. Pitacco (1978), Su una generalizzazione del problema del commesso viaggiatore, *Rivista di Matematica per le Scienze economiche e sociali*, **1** (2): 51-66

M. Umani, E. Pitacco (1973), Un sistema generalizzato per l'aggiornamento di flussi di dati sequenziali, *L'Elaborazione Automatica*, **1** (4): 7-24

E. Pitacco (1973), Un algoritmo per l'interpretazione di stringhe di significato numerico, *L'Elaborazione Automatica*, **1** (3): 63-72

## Contributions to collective works

A.R. Bacinello, P. Millosovich, A. Olivieri, E. Pitacco (2012), Variable annuities as life insurance packages: a unifying approach to the valuation of guarantees, in: Michèle Vanmaele, Griselda Deelstra, Ann De Schepper, Jan Dhaene, Wim Schoutens, Steven Vanduffel, David Vyncke (Eds.), *Actuarial and financial mathematics conference. Interplay between Finance and Insurance*, Koninklijke Vlaamse Academie van België voor Wetenschappen en Kunsten, Brussel: 3-15

A. Olivieri, E. Pitacco (2009), Solvency requirements for life annuities allowing for mortality risks: internal models versus standard formulas, in: M. Cruz (Ed.), *The Solvency II Handbook. Developing ERM frameworks in insurance and reinsurance companies*, Risk Books: 371-397

E. Pitacco (2009), "Trieste: a Node of the Actuarial Network in the Early 1900s". In: W. Hafner, H. Zimmermann (Eds), *Vinzenz Bronzin's Option Pricing Models. Exposition and Appraisal*, Springer: 407-424

E. Pitacco (2008), "Insurance Applications of Life Tables". In: E. Melnick, B. Everitt (Eds), *Encyclopedia of Quantitative Risk Assessment and Analysis*, J. Wiley & Sons: 916-921

E. Pitacco (2007), Teaching life insurance mathematics in a risk management perspective: stochastic mortality issues. In: *Sensei in het actuaariaat. Liber Amicorum voor prof. dr. Henk Wolthuis AAG*, Universiteit van Amsterdam: 123-146

E. Pitacco (2004), "de Finetti, Bruno". In: J. L. Teugels, B. Sundt (Eds), *Encyclopedia of Actuarial Science*, J. Wiley & Sons, vol. 1: 421-423

E. Pitacco (2004), "Disability Insurance". In: J. L. Teugels, B. Sundt (Eds), *Encyclopedia of Actuarial Science*, J. Wiley & Sons, vol. 1: 530-541

E. Pitacco (2004), "Disability Insurance, Numerical Methods". In: J. L. Teugels, B. Sundt (Eds), *Encyclopedia of Actuarial Science*, J. Wiley & Sons, vol. 1: 541-548

E. Pitacco (2004), Longevity risk in living benefits. In: E. Fornero, E. Luciano (Eds), *Developing an annuity market in Europe*, Edward Elgar, Cheltenham: 132-167

E. Pitacco (2002), Un'introduzione al longevity risk. In: *Liber Amicorum per Alessandro Di Lorenzo*, Dipartimento di Matematica e Statistica, Università Federico II, Napoli: 309-323

- E. Pitacco (2002), Le coperture Income Protection, Dread Disease, Long Term Care. In: A.D. Candian, S. Paci (Eds), *Manuale di Tecnica delle Assicurazioni*, Giuffrè Editore, Milano, vol. 2: 1379-1403
- E. Pitacco (2001), Modelli previdenziali nel nuovo scenario demografico. In: Editoriale Generali, *Fondi pensione e sviluppo economico*, Convegno Industria e Assicurazione, Villa Manin di Passariano (UD): 159-177
- E. Pitacco (1999), La gestione assicurativa del "rischio salute". In: Assicurazioni Generali, *Riforma del sistema sanitario assistenziale. Convergenza tra pubblico e privato*, Convegno Industria e Assicurazione, Villa Manin di Passariano (UD): 11-46
- E. Pitacco (1998), Possibilità di innovazione nella progettazione di coperture assicurative per persone a livello di collettività. In: G. Iudica (Ed.), *I fondi di previdenza e di assistenza complementare*, CEDAM, Padova: 33-53
- E. Pitacco (1997), Tipologia e localizzazione dei rischi nella previdenza complementare. In: Assicurazioni Generali, *Fondi pensione: per un capitalismo responsabile*, Convegno Industria e Assicurazione, Villa Manin di Passariano (UD): 83-105
- E. Pitacco (1996), Recenti modelli attuariali per le assicurazioni di persone, *Atti delle Giornate di Studio "Finanza matematica e matematica attuariale. Aspetti teorici e pratici"*, Pubbl. No. 3 del Dipartimento di Matematica Applicata alle Scienze Economiche, Statistiche ed Attuariali, Università di Trieste: 71-91
- E. Pitacco, L. Picech, L. Sigalotti (1993), Reserving in Italy. In: H. Wolthuis, M.J. Goovaerts (Eds), *Reserving and Solvency in Insurance in the EC*, CAIRE Insurance and Finance Series, vol. 1: 225-248
- E. Pitacco (1991), Le assicurazioni sulla salute. Forme individuali e collettive. In: Assicurazioni Generali, *La crisi dello stato sociale: nuovi rapporti tra pubblico e privato*, Convegno Industria e Assicurazione, Villa Manin di Passariano (UD): 33-46
- E. Pitacco (1990), Sulla riserva "prospettiva effettiva" in assicurazione malattia. In: *Scritti in omaggio a L. Daboni*, Pubbl. No. 2 del Dipartimento di Matematica Applicata alle Scienze Economiche, Statistiche ed Attuariali, Università di Trieste: 377-390
- E. Pitacco, M. Zecchin (1989), La previdenza in Italia. In: *Le pensioni nel 2010*, Ed. Unistampa, Roma: 59-88
- E. Pitacco, A.R. Bacinello (1986), Contributi in elaborazione automatica dei dati e assicurazioni vita, *Atti del Convegno "Ricordo di Bruno de Finetti professore nell'Ateneo triestino"*, Pubbl. No. 1 del Dipartimento di Matematica Applicata alle Scienze Economiche, Statistiche ed Attuariali, Università di Trieste: 149-169
- E. Pitacco (1986), Solvency margin and profit in life insurance. In: M. Goovaerts, F. de Vylder, J. Haezendonck (Eds), *Insurance and Risk Theory*, D. Reidel: 435-445
- E. Pitacco (1986), Simulation in insurance. In: M. Goovaerts, F. de Vylder, J. Haezendonck (Eds), *Insurance and Risk Theory*, D. Reidel: 37-77

E. Pitacco (1984), Simulation in actuarial work. Some computational problems. In: M. Goovaerts, F. de Vylder, J. Haezendonck (Eds), *Premium Calculation in Insurance*, D. Reidel: 467-474

L. Daboni, E. Pitacco (1983), Gli studi statistici ed attuariali nel Friuli - Venezia Giulia. In: La ricerca scientifica - 1° aggiornam. *Enciclopedia Monografica del Friuli - Venezia Giulia*

E. Pitacco (1974), Sul problema dell'elencazione ordinata degli elementi di un insieme dotato d'ordine parziale. In: *Raccolta di Scritti per il 50° anniversario della Facoltà di Economia e Commercio dell'Università di Trieste*, Trieste: 255-265

## Articles in conference proceedings

Pitacco E. (2010), Rendite vitalizie: tra vecchie formule e nuovi scenari, *Atti del Convegno "Economia e Incertezza"*, EUT (Edizioni Università di Trieste): 137-155

E. Pitacco (2007), Mortality and longevity: a risk management perspective, Invited lecture at the 1<sup>st</sup> IAA Life Section Colloquium, Stockholm  
(<http://www.actuaries.org/LIFE/Events/Stockholm/Pitacco.pdf>)

A. Olivieri, E. Pitacco (2006), The cost of target capital in the valuation of the life annuity business, *Transactions of the 28th International Congress of Actuaries*, Parigi  
(<http://papers.ica2006.com/Papiers/2006/2006.pdf> )

E. Pitacco (2005), La formazione attuariale: istruzione universitaria, formazione permanente, "business orientation", *Atti del VII Congresso Nazionale degli Attuari*, Verona: 449-457

E. Pitacco (2004), Prodotti assicurativi sanitari e previdenziali nel nuovo scenario demografico. Profili attuariali, *Atti del VI Congresso Nazionale di Scienza e Tecnica delle Assicurazioni*, Bologna: 261-289

E. Pitacco (2002), Introduzione all'analisi dei rischi e della solvibilità nelle assicurazioni vita, *Atti della Scuola Estiva "Finanza Quantitativa"*, Auronzo di Cadore (BL): 435-460

A. Olivieri, E. Pitacco (2002), Inference about mortality improvements in life annuity portfolios, *Transactions of the 27th International Congress of Actuaries*, Cancun, Mexico  
([http://www.actuaries.org/EVENTS/Congresses/Cancun/ica2002\\_subject/mortality/mortality\\_76\\_olivieri\\_pitacco.pdf](http://www.actuaries.org/EVENTS/Congresses/Cancun/ica2002_subject/mortality/mortality_76_olivieri_pitacco.pdf) )

A. Olivieri, E. Pitacco (2001), Facing LTC Risks, *Proceedings of the 32nd ASTIN Colloquium*, Washington, and *Proceedings of the 5th International Congress on Insurance: Mathematics & Economics*, vol. 2, Pennsylvania State University

E. Pitacco (2001), Assessing and facing the longevity risk. Financial requirements, *Proceedings of the 4th Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics*, Alghero: 528-560

E. Pitacco (2001), Risks and solvency in life insurance, *Proceedings of the 2nd Italian-Spanish Conference on Financial Mathematics*, Napoli: 53-76

- A. Olivieri, E. Pitacco (2000), Modelling disability. Applications to personal accident insurance, *Proceedings of the 4th International Congress on Insurance: Mathematics & Economics*, Barcellona
- A. Olivieri, E. Pitacco (2000), Solvency requirements for life annuities, *Proceedings of the 10th AFIR Colloquium*, Tromsø (Norway): 547-571
- A. Olivieri, E. Pitacco (1999), Funding sickness benefits for the elderly, *Proceedings of the XXX International ASTIN Colloquium*, Tokyo:135-155
- P. Marocco, E. Pitacco (1998), Longevity risk and life annuity reinsurance, *Transactions of the 26th International Congress of Actuaries*, Birmingham, vol. 6: 453-479
- E. Pitacco (1998), Gli aspetti economici ed attuariali dell'assistenza sanitaria complementare, *Atti del VI Congresso Nazionale degli Attuari*, Milano: 407-420
- A. Olivieri, E. Pitacco (1997), Sulla nozione di prudenzialità in assicurazione vita: profili attuariali e finanziari, *Atti del XXI Convegno AMASES*, Roma: 515-530
- E. Pitacco (1997), Inference about the parameters of multiple state models in health insurance, *Proceedings of the XXVIII ASTIN Colloquium*, Cairns (Australia): 239-251
- A. Olivieri, E. Pitacco (1996), Modelli di valutazione per prodotti assicurativi vita nel nuovo scenario normativo, *Atti del XX Convegno AMASES*, Urbino: 489-504
- E. Pitacco (1996), Il "rischio salute" nell'ambito delle assicurazioni vita. Profili tecnico-attuariali, *Atti del V Congresso nazionale di Scienza delle Assicurazioni*, Torino: 65-76
- E. Pitacco (1995), Collective life insurance indexing. A multistate approach, *Transactions of the 25th International Congress of Actuaries*, Brussels, vol. 1: 335-356
- E. Pitacco (1994), LTC Insurance. From the multistate model to practical implementations, *Proceedings of the XXV ASTIN Colloquium*, Cannes: 437-452
- E. Pitacco (1993), I modelli multistato: un linguaggio per la matematica attuariale, *Atti del XVII Convegno AMASES*, Ischia
- E. Pitacco (1992), Sui modelli attuariali per rendite d'invalidità, *Atti del XVI Convegno AMASES*, Treviso
- E. Pitacco (1992), Risk classification and experience rating in sickness insurance, *Transactions of the 24th International Congress of Actuaries*, Montreal (Canada), vol. 3: 209-221
- E. Pitacco (1991), Bruno de Finetti: un matematico agli esordi dell'informatica, *Atti del Convegno Internazionale sulla storia e preistoria del calcolo automatico e dell'informatica*, Siena: 151-168
- E. Pitacco (1991), An inference model for risks with variable claim frequency rate, *Proceedings of the XXIII ASTIN Colloquium*, Stockholm
- E. Pitacco (1990), Sulla politica di retrocessione degli utili finanziari in assicurazione vita, *Atti delle Giornate di Lavoro AIRO90*, Sorrento (NA)

E. Pitacco (1989), Adjustment problems in permanent health insurance, *Proceedings of the XXI ASTIN Colloquium*, New York

A.R. Bacinello, E. Pitacco (1989), Esperienze di sviluppo software per il calcolo attuariale, *Atti del Convegno annuale 1989 AICA*, Trieste

E. Pitacco (1988), Assicurazioni vita e fondi d'investimento: analisi del rischio finanziario, *Atti delle Giornate di Lavoro AIRO88*, Pisa

E. Pitacco (1988), A stochastic model for deposit administration plan analysis, *Transactions of the 23rd International Congress of Actuaries*, Helsinki

E. Pitacco (1988), Un modello simulativo per l'analisi di un portafoglio di assicurazioni vita, *Atti del Congresso Annuale 1988 AICA*, Cagliari

E. Pitacco, L. Sigalotti (1987), On weighted distributions in actuarial problems, *Proceedings of the XX ASTIN Colloquium*, Scheveningen (The Netherlands)

E. Pitacco (1986), Per una visione unitaria dei modelli tecnico-gestionali in assicurazione vita, *Atti delle Giornate di Lavoro AIRO86*, Roma

E. Pitacco (1984), Il valore tecnico e patrimoniale del portafoglio nella gestione di un'impresa di assicurazioni vita, *Atti delle Giornate di Lavoro AIRO84*, Pescara

E. Pitacco (1983), Sul calcolo del valore tecnico di un portafoglio vita, *Atti del VII Convegno AMASES*, Acireale (CT)

E. Pitacco (1983), Sulla proiezione simulata della riserva di un portafoglio vita, *Atti del Convegno 1983 della Società Italiana di Statistica*, Trieste

E. Pitacco (1981), Analisi mediante procedimento simulativo di una tariffa R.C.Auto personalizzata, *Atti delle Giornate di Lavoro AIRO81*, Torino

E. Pitacco (1980), Spunti per la costruzione di una tariffa RCA personalizzata, *Atti del III Convegno Nazionale degli Attuari*, Trieste

L. Crisma, E. Pitacco (1979), Un metodo di simulazione per l'ulteriore durata in vita di un individuo, *Atti del III Convegno AMASES*, Napoli

E. Pitacco (1979), Simulazione di un processo "mistura di Poisson": un'applicazione attuariale, *Atti delle Giornate di Lavoro AIRO79*, Bologna

E. Pitacco (1977), Su una generalizzazione del problema del commesso viaggiatore, *Atti delle Giornate di Lavoro AIRO77*, Parma

## **Working papers and reports**

A. Ahcan, D. Medved, E. Pitacco, J. Sambt, R. Sraka (2012), *Slovenian Annuity Tables*, Faculty of Economics, University of Ljubljana, Ljubljana

E. Pitacco (2012), From "benefits" to "guarantees": looking at life insurance products in a new framework, CEPAR Working Paper 2012 / 26, University of New South Wales, Sydney, Available at:

[http://www.cepar.edu.au/media/103403/lecturetext\\_pitacco.pdf](http://www.cepar.edu.au/media/103403/lecturetext_pitacco.pdf)



- E. Pitacco (2012), Mortality of disabled people, Working paper, Available at SSRN: <http://ssrn.com/abstract=1992319>, and at: [http://www.actuaries.org/CTTEES\\_TFM/Documents/Mortality\\_Disabled.pdf](http://www.actuaries.org/CTTEES_TFM/Documents/Mortality_Disabled.pdf)
- A. R. Bacinello, P. Millosovich, A. Olivieri, E. Pitacco (2010), Variable Annuities: Risk Identification and Risk Assessment, CAREFIN Working Paper 14/2010, Università Bocconi, Milano
- A. Olivieri, E. Pitacco (2006), Life annuities and longevity dynamics, Working Paper No. 36, CERAP – Università Bocconi, Milano
- E. Pitacco (2005), Contributions to the topic: "Insurances of the person" in: *Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari (1930 - 2003)*. Available at SSRN: <http://ssrn.com/abstract=1680922>
- E. Pitacco, A. Olivieri (2005), Forecasting mortality: an introduction, Working Paper No. 35, CERAP – Università Bocconi, Milano
- A. Olivieri, E. Pitacco (2003), Annuitisation guarantee and uncertainty in mortality trends, Working Paper No. 30, CERAP – Università Bocconi, Milano
- E. Pitacco (2003), Survival models in actuarial mathematics: from Halley to longevity risk, Quad. No. 2/2003 del Dipartimento di Matematica Applicata alle Scienze Economiche Statistiche e Attuariali, Università di Trieste
- A. Olivieri, E. Pitacco (2001), Rendite vitalizie: longevity risk, garanzie demografiche, profili tariffari, Working Paper No. 22, CERAP - Università Bocconi, Milano
- S. Haberman, A. Olivieri, E. Pitacco (1997), Multiple state modelling and Long term care insurance, Paper presented to the Staple Inn Actuarial Society
- A. Olivieri, E. Pitacco (1997), Riserve matematiche, basi tecniche, prudenzialità e formazione dell'utile nelle assicurazioni vita, Working Paper No. 14, CERAP – Università Bocconi, Milano
- E. Pitacco (1997), Tavole di mortalità proiettate e loro impiego in ambito attuariale. Appunti introduttivi, Quad. No. 1/1997 del Dipartimento di Matematica Applicata alle Scienze Economiche, Statistiche ed Attuariali, Università di Trieste
- A. Olivieri, E. Pitacco (1996), Rischio demografico e riassicurazione per portafogli di rendite vitalizie, Working Paper No. 12, CERAP – Università Bocconi, Milano
- E. Pitacco (1994), Modelli attuariali per le assicurazioni "Long Term Care", Working Paper No. 8, CERAP – Università Bocconi, Milano
- E. Pitacco (1994), Aspetti tecnico-attuariali delle assicurazioni infortuni, Working Paper No. 7, CERAP – Università Bocconi, Milano
- E. Pitacco (1994), Profili attuariali delle assicurazioni contro le malattie. Premi, riserve, adeguamento delle prestazioni, Quad. No. 44 dell'Istituto per gli Studi Assicurativi, Trieste
- E. Pitacco (1993), Modelli probabilistici multistato per assicurazioni di persone. Appunti introduttivi. Quad. No. 10/1993 del Dipartimento di Matematica Applicata alle Scienze Economiche, Statistiche ed Attuariali, Università di Trieste

- E. Pitacco (1992), Riflessioni su aspetti attuariali delle rendite d'invalidità, Contributi di ricerca in Matematica finanziaria e Scienze attuariali, No.1, Università Cattolica del S. Cuore, Milano
- E. Pitacco (1992), Tariffazione in base all'esperienza e sistemi bonus-malus, Quad. No. 42 dell'Istituto per gli Studi Assicurativi, Trieste
- E. Pitacco (1992), Politiche di determinazione del prezzo di riscatto in assicurazione vita, Quad. No. 42 dell'Istituto per gli Studi Assicurativi, Trieste
- E. Pitacco (1992), Sulla personalizzazione del premio in assicurazioni malattia, Quad. No. 2/1992 del Dipartimento di Matematica Applicata alle Scienze Economiche, Statistiche ed Attuariali, Università di Trieste
- E. Pitacco (1991), Selection and Experience Rating in Health Insurance, Quad. No. 6/1991 del Dipartimento di Matematica Applicata alle Scienze Economiche, Statistiche ed Attuariali, Università di Trieste
- E. Pitacco (1989), L'assicurazione contro le malattie. Aspetti tecnico-attuariali, Quad. No. 23 del Dipartimento di Matematica Applicata alle Scienze Economiche, Statistiche ed Attuariali, Università di Trieste
- E. Pitacco (1989), La gestione tecnica dell'impresa di assicurazione: riserve e guadagni. Il ramo vita, Quad. No. 22 del Dipartimento di Matematica Applicata alle Scienze Economiche, Statistiche ed Attuariali, Università di Trieste
- E. Pitacco, L. Sigalotti (1987), La formazione attuariale universitaria ed extra-universitaria in Gran Bretagna, Quad. No. 39 dell'Istituto per gli Studi Assicurativi, Trieste
- E. Pitacco (1987), Le assicurazioni collettive sulla vita. Generalità ed aspetti attuariali, Quad. No. 1 del Dipartimento di Matematica Applicata alle Scienze Economiche, Statistiche ed Attuariali, Università di Trieste
- E. Pitacco (1983), Algoritmi e programmi, Quad. No. 36 dell'Istituto per gli Studi Assicurativi, Trieste
- E. Pitacco (1983), L'adeguamento delle prestazioni nelle assicurazioni vita: aspetti attuariali e finanziari, Quad. dell'Istituto di Matematica applicata alle Scienze economiche e sociali, Università di Firenze
- E. Pitacco (1979), Considerazioni sul metodo di simulazione in problemi attuariali, Quad. No. 25 dell'Istituto di Matematica Finanziaria dell'Università di Trieste
- E. Pitacco (1979), Un procedimento per la valutazione di un portafoglio di assicurazioni miste a capitale crescente, Quad. No. 32 dell'Istituto per gli Studi Assicurativi, Trieste
- E. Pitacco (1978), Sull'adeguamento dei premi in tariffe assicurative "personalizzate", Quad. No. 22 dell'Istituto di Matematica Finanziaria dell'Università di Trieste
- E. Pitacco (1978), Valutazioni di grandezze interessanti la tariffa bonus-malus in RCA: un approccio simulativo, Quad. della Facoltà di Economia e Commercio dell'Università di Trieste
- E. Pitacco (1977), Sulla rappresentazione mediante un modello markoffiano della evoluzione della sinistrosità automobilistica, Quad. No. 31 dell'Istituto per gli Studi Assicurativi, Trieste

E. Pitacco (1977), Questioni riguardanti la simulazione di processi stocastici, Quad. della Facoltà di Economia e Commercio dell'Università di Trieste

E. Pitacco (1976), Sull'impiego di strutture "a lista" in algoritmi di ricerca operativa, Quad. No. 9 dell'Istituto di Statistica dell'Università di Trieste

E. Pitacco (1976), Notizie e considerazioni sulle procedure di ottimizzazione di tipo branch and bound, Quad. No. 16 dell'Istituto di Matematica Finanziaria dell'Università di Trieste

E. Pitacco (1976), Sulla determinazione dei punti di ottimo pareto in problemi finiti di ottimizzazione a due criteri, Quad. della Facoltà di Economia e Commercio dell'Università di Trieste

E. Pitacco (1974), Elementi di matematica per programmatori, Quad. No.1 (Collana didattica) del Centro di Calcolo dell'Università di Trieste

E. Pitacco (1974), Riflessioni sulla tecnica reticolare MPM con riferimento alla relazione d'ordine parziale, Quad. della Facoltà di Economia e Commercio dell'Università di Trieste

E. Pitacco (1974), ANTE73: un programma per il calcolo dei tempi fondamentali di una rete di attività organizzata secondo il metodo degli antecedenti, Quad. No. 8 del Centro di Calcolo dell'Università di Trieste