

Anna Battauz

ASSOCIATE PROFESSOR

Financial Markets

ANNA.BATTAUZ@UNIBOCCONI.IT

Biografia

Anna Battauz è Associate Professor presso l'Università Bocconi, dove tiene corsi per studenti universitari, laureati e dottorandi in Calculus, Quantitative Finance, Derivatives Pricing, Numerical Methods for Finance, and Continuous-Time Finance. Dal 2022 è Direttrice del Master in Finance.

I suoi interessi di ricerca sono nella Finanza Quantitativa, con un focus particolare sulla prezzatura di asset/derivati, allocazione di asset e fermate ottimali. Ha pubblicato su diverse riviste accademiche, tra cui Economic Theory, Journal of Economic Dynamics and Control, Management Science, Quantitative Finance e Review of Derivatives Research. Agisce come referente per diverse pubblicazioni accademiche ed è research fellow presso IGIER (Innocenzo Gasparini Institute for Economic Research) e Baffi Carefin.

Si è laureata alla Scuola Normale Superiore di Pisa con un Dottorato in Matematica Finanziaria. Possiede anche una Laurea in Matematica presso l'Università di Udine. Si è unita all'Università Bocconi subito dopo il suo dottorato.

ARTICOLI SU RIVISTA SCIENTIFICA

BATTAUZ A., DE DONNO M., SBUELZ A.

On the exercise of American quanto options

The North American Journal of Economics and Finance, 2022, vol.62, pp.101738

BATTAUZ A., ROTONDI F.

American options and stochastic interest rates

Computational Management Science, 2022, vol.19, pp.567–604

BATTAUZ A., DE DONNO M., GAJDA J., SBUELZ A.

Optimal exercise of American put options near maturity: A new economic perspective

Review of Derivatives Research, 2022, vol.25, pp.23–46

BATTAUZ A., GATTI S., PRENCIPE A., VIARENKO L.

Earnouts: The real value of disagreement in mergers and acquisitions*

European Financial Management, 2021, vol.27, no. 5, pp.981–1024

BATTAUZ A., SBUELZ A.

Non-myopic portfolio choice with unpredictable returns: The jump-to-default case

European Financial Management, 2018, vol.24, no. 2, pp.192–208

BATTAUZ A., DE DONNO M., SBUELZ A.

Reaching nirvana with a defaultable asset?

Decisions in Economics and Finance, 2017, vol.40, no. 1–2, pp.31–52

BATTAUZ A., DE DONNO M., ORTU F.

Envelope theorems in Banach lattices and asset pricing

Mathematics and Financial Economics, 2015, vol.9, no. 4, pp.303–323

BATTAUZ A., DE DONNO M., SBUELZ A.

Real Options and American Derivatives: The Double Continuation Region

Management Science, 2015, vol.61, no. 5, pp.1094–1107

BATTAUZ A., DE DONNO M., SBUELZ A.

Kim and Omberg Revisited: The Duality Approach

Journal of Probability and Statistics, 2015, vol.2015, pp.1–6

BATTAUZ A., DONNO M. D., SBUELZ A.

Real options with a double continuation region

Quantitative Finance, 2012, vol.12, no. 3, pp.465–475

BATTAUZ A., DE DONNO M., ORTU F.

Intertemporal asset pricing and the marginal utility of wealth

Journal of Mathematical Economics, 2011, vol.47, no. 2, pp.227–244

BATTAUZ A., ORTU F.

Dynamic versus one-period completeness in event-tree security markets

Economic Theory, 2006, vol.30, no. 1, pp.191–193

BACCARA M., BATTAUZ A., ORTU F.

Effective securities in arbitrage-free markets with bid–ask spreads at liquidation: a linear programming characterization

Journal of Economic Dynamics and Control, 2006, vol.30, no. 1, pp.55–79

BATTAUZ A., PRATELLI M.

Optimal stopping and American options with discrete dividends and exogenous risk

Insurance: Mathematics & Economics, 2004, vol.35, no. 2, pp.255–265
