

Claudio Tebaldi

ASSOCIATE PROFESSOR

Financial Markets

CLAUDIO.TEBALDI@UNIBOCCONI.IT

Biografia

Claudio Tebaldi è Professore Associato presso l'Università Bocconi dal 2011. È in possesso della Qualifica Nazionale a Professore Ordinario in Quantitative Methods for Economics, Finance, and Insurance dal 2015.

I suoi interessi di ricerca sono interdisciplinari. Nell'ambito dell'economia finanziaria, si concentrano principalmente su asset, derivative pricing e risk management. Nell'ambito delle scienze matematiche e fisiche, la sua ricerca è focalizzata sulla teoria della complessità e sui fenomeni collettivi. L'obiettivo della sua ricerca è duplice: in primo luogo, dimostrare che principi economici adeguatamente formulati producono una descrizione credibile di questi risultati collettivi. In secondo luogo, identificare regole decisionali robuste ed efficienti e approcci regolamentari che si basino su metodi statistici avanzati (come il machine learning o l'analisi dei big data) per aiutare gli individui a fronteggiare questo ambiente rischioso. Ha ricevuto premi internazionali per la sua ricerca, come il Best Paper in Derivatives per il NFA 2019 e il Best Paper della Swiss Econometrics and Finance Society nel 2007. Svolge il ruolo di Managing Editor della rivista Quantitative Finance. È stato invitato e ha visitato regolarmente numerose istituzioni di ricerca e policy pubbliche e private, tra cui UCLA, NYU, NORDITA, l'Università di Copenaghen, la Federal Reserve Board, la BCE, la Deutsche Bundesbank, la Direzione Affari Finanziari dell'Unione Europea e Bloomberg.

Ha conseguito un Dottorato in Statistical Mechanics presso la SISSA Scuola Internazionale Superiore di Studi Avanzati e un Master in Economics and Finance presso la Venice International University.

ARTICOLI SU RIVISTA SCIENTIFICA

BURASCHI A., TEBALDI C.

Financial Contagion in Network Economies and Asset Prices

Management Science, 2024, vol.70, no. 1, pp.485-506

CERREIA-VIOGLIO S., ORTU F., SEVERINO F., TEBALDI C.

Multivariate Wold decompositions: a Hilbert A-module approach

Decisions in Economics and Finance, 2023, vol.46, no. 1, pp.45-96

CASTAGNOLI E., CATTELAN G., MACCHERONI F. A., TEBALDI C., WANG R.

Star-Shaped Risk Measures

Operations Research, 2022, vol.70, no. 5, pp.2637-2654

CARR P., TEBALDI C.

Financial Interpretation of Feller's Factorization

Journal of Derivatives, 2022, vol.30, no. 2, pp.49-63

DI GIACINTO M., TEBALDI C., WANG T.

Optimal order execution under price impact: a hybrid model

Annals of Operations Research, 2022

GRUBER P. H., TEBALDI C., TROJANI F.

The Price of the Smile and Variance Risk Premia

Management Science, 2021, vol.67, no. 7, pp.4056-4074

TEBALDI C.

Self-Organized Criticality in Economic Fluctuations: The Age of Maturity

Frontiers in Physics, 2021, vol.8, pp.616408

ORTU F., SEVERINO F., TAMONI A., TEBALDI C.

A persistence-based Wold-type decomposition for stationary time series

Quantitative Economics, 2020, vol.11, no. 1, pp.203-230

BANDI F., PERRON B., TAMONI A., TEBALDI C.

The scale of predictability

Journal of Econometrics, 2019, vol.208, no. 1, pp.120-140

BISSETTI E., FAVERO C. A., NOCERA G., TEBALDI C.

A Multivariate Model of Strategic Asset Allocation with Longevity Risk

Journal of Financial and Quantitative Analysis, 2017, vol.52, no. 5, pp.2251-2275

ORTU F., TAMONI A., TEBALDI C.

Long-Run Risk and the Persistence of Consumption Shocks

Review of Financial Studies, 2013, vol.26, no. 11, pp.2876-2915

PERISSINOTTO L., TEBALDI C.

A "coherent state transform" approach to derivative pricing

International Journal of Theoretical and Applied Finance, 2009, vol.12, no. 02, pp.125-151

DA FONSECA J., GRASSELLI M., TEBALDI C.

A multifactor volatility Heston model

Quantitative Finance, 2008, vol.8, no. 6, pp.591-604

GRASSELLI M., TEBALDI C.

Solvable affine term structure models

Mathematical Finance, 2008, vol.18, no. 1, pp.135-153

FONSECA J. D., GRASSELLI M., TEBALDI C.

Option pricing when correlations are stochastic: an analytical framework

Review of Derivatives Research, 2007, vol.10, no. 2, pp.151-180

GRASSELLI M., TEBALDI C.

Stochastic Jacobian and Riccati ODE in affine term structure models

Decisions in Economics and Finance, 2007, vol.30, no. 2, pp.95-108

TEBALDI C.

Hedging using simulation: a least squares approach

Journal of Economic Dynamics and Control, 2005, vol.29, no. 8, pp.1287-1312

GRASSELLI M., TEBALDI C.

Bond Price and Impulse Response Function for the Balduzzi, Das, Foresi and Sundaram (1996) Model

Economic Notes, 2004, vol.33, no. 3, pp.359-374

TEBALDI C.

Hedging a Portfolio of Derivative Securities: A Simulation Approach

Economic Notes, 2001, vol.30, no. 2, pp.257-279

TEBALDI C., DE MENECH M., STELLA A. L.

Multifractal Scaling in the Bak-Tang-Wiesenfeld Sandpile and Edge Events

Physical Review Letters, 1999, vol.83, no. 19, pp.3952-3955

DE MENECH M., STELLA A. L., TEBALDI C.

Rare events and breakdown of simple scaling in the Abelian sandpile model

Physical Review E, 1998, vol.58, no. 3, pp.R2677-R2680

CALDARELLI G., TEBALDI C., STELLA A. L.

Branching Processes and Evolution at the Ends of a Food Chain

Physical Review Letters, 1996, vol.76, no. 26, pp.4983-4986

STELLA A. L., TEBALDI C., CALDARELLI G.

Self-organized critical scaling at surfaces

Physical Review E, 1995, vol.52, no. 1, pp.72-75

CONTRIBUTI IN VOLUME, CAPITOLI O SAGGI SCIENTIFICI

DI VIRGILIO D., ORTU F., SEVERINO F., TEBALDI C.

Optimal Asset Allocation with Heterogeneous Persistent Shocks and Myopic and Intertemporal Hedging Demand in *Behavioral Finance: the coming of age*

Itzhak Venezia (a cura di), World Scientific Publishers, pp.57-108, 2019

TEBALDI C., VERONESI P.

Risk-Neutral Pricing: Monte Carlo Simulations in *Handbook of Fixed-Income Securities*

Pietro Veronesi (a cura di), John Wiley & Sons, chap. 19, pp.435-468, 2016

TEBALDI C., VERONESI P.

Risk-Neutral Pricing: Trees in *Handbook of Fixed-Income Securities*

Pietro Veronesi (a cura di), John Wiley & Sons, chap. 17, pp.389-413, 2016

Grants & Premi

Excellence in Research Award - Università Commerciale Luigi Bocconi , 2023
