

# 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, a livello triennale e magistrale, e per dottorandi in Calculus, Quantitative Finance, Derivatives Pricing, Numerical Methods for Finance, and Continuous-Time Finance. Dal 2022 è Direttrice del Master of Science in Finance.

I suoi interessi di ricerca sono nella Finanza Quantitativa, con un focus particolare sulla valutazione di titoli derivati, i problemi di allocazione di portafoglio e l'applicazione finanziaria delle tecniche di esercizio ottimale. 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.

Ha conseguito il Perfezionamento (Dottorato) in Matematica Finanziaria alla Scuola Normale Superiore di Pisa dopo la 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., STAFFOLANI S.

**American options with acceleration clauses**

Decisions in Economics and Finance, 2024

BATTAUZ A., ROTONDI F.

**Optimal liquidation policies of redeemable shares**

Computational Management Science, 2024, vol.21, no. 2

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., VIARENGO L.

**Earnings: 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

---

## Grants & Premi

Teaching Excellence Award - Università Commerciale Luigi Bocconi , 2018

Research Excellence Award - Università Commerciale Luigi Bocconi , 2014

Research Excellence Award - Università Commerciale Luigi Bocconi , 2004

---

