

Maria Debora Braga

Affiliate Professor



Knowledge Group: Finance

Research Domains: Private Banking and Wealth Management

Teaching Domains: Asset Allocation and Portfolio Management,
Performance Management, Financial Markets & Instruments, Private
Banking, Sustainable Accounting & Finance

mariadebora.braga@sdabocconi.it

Articles in Scholarly Journals

Detecting exuberance phenomena in thematic investing

BRAGA, M. D., G. GENONI, G. VACCA, "Detecting exuberance phenomena in thematic investing", Finance Research Letters, 2025, vol. 75, pp. 106889

Kurtosis-based vs volatility-based asset allocation strategies: Do they share the same properties? A first empirical investigation

BRAGA, M. D., C. R. NAVA, M. G. ZOIA, "Kurtosis-based vs volatility-based asset allocation strategies: Do they share the same properties? A first empirical investigation", Finance Research Letters, 2023, vol. 54, pp. 103797

Kurtosis-based risk parity: methodology and portfolio effects

BRAGA, M. D., C. R. NAVA, M. G. ZOIA, "Kurtosis-based risk parity: methodology and portfolio effects", Quantitative Finance, 2023, vol. 23, no. 3, pp. 453-469

Strategie di risk reduction per i portafogli : un primo esame = Portfolio risk reduction strategies for different investors

BRAGA, M. D., "Strategie di risk reduction per i portafogli : un primo esame = Portfolio risk reduction strategies for different investors", Bancaria, 2017, vol. 73, no. 7-8, pp. 47-55

Risk parity versus other μ -free strategies: a comparison in a triple view

BRAGA, M., "Risk parity versus other μ -free strategies: a comparison in a triple view", Investment Management and Financial Innovations, 2015, vol. 12, no. 1-2, pp. 277-289

Hedge fund di diritto italiano: commissioni di incentivo, discrezionalità e performance

BRAGA, M., A. BURCHI, "Hedge fund di diritto italiano: commissioni di incentivo, discrezionalità e performance", Economia & Management, 2013, no. 3, pp. 81-94

Performance e arrangements contrattuali degli hedge fund italiani

BURCHI, A., M. BRAGA, "Performance e arrangements contrattuali degli hedge fund italiani", *Bancaria*, 2012, vol. 68, no. 11, pp. 54-63

Active risk sensitivity to views using the Black–Litterman model

BRAGA, M., F. P. NATALE, "Active risk sensitivity to views using the Black–Litterman model", *Journal of Asset Management*, 2011, vol. 13, pp. 5-21

Gli Etf strutturati: opportunità e rischi per l'investitore

BRAGA, M., "Gli Etf strutturati: opportunità e rischi per l'investitore", *Bancaria*, 2011, vol. 67, no. 3, pp. 62-77

Gli hedge fund dopo la crisi: nuovi approcci per misurare il rischio

BRAGA, M. D., "Gli hedge fund dopo la crisi: nuovi approcci per misurare il rischio", *Bancaria*, 2009, vol. 9

Il pricing dell'attività di consulenza nel risparmio gestito: profili finanziari e normativi

BRAGA, M. D., P. CUCURACHI, E. CARLUCCIO, "Il pricing dell'attività di consulenza nel risparmio gestito: profili finanziari e normativi", *Bancaria*, 2008, vol. 64, no. 9, pp. 22-41

Online mutual funds supermarkets: quale coerenza con i principi del financial planning?

BRAGA, M. D., "Online mutual funds supermarkets: quale coerenza con i principi del financial planning?", *Banche e Banchieri*, 2002, vol. 29, no. 3, pp. 300-310

Contribution to Chapters, Books or Research Monographs

Strategic Asset Allocation with Mean-Variance Optimisation

BRAGA, M. D., "Strategic Asset Allocation with Mean-Variance Optimisation" in *Asset Management and Institutional Investors*, Ignazio Basile, Pierpaolo Ferrari (Eds.), Springer International Publishing, pp. 117-202, 2024

Methods and Tools for Portfolio Selection

BRAGA, M. D., "Methods and Tools for Portfolio Selection" in *Asset Management and Institutional Investors*, Ignazio Basile, Pierpaolo Ferrari (Eds.), Springer International Publishing, pp. 203-242, 2024

Alternative Approaches to Traditional Mean-Variance Optimisation

BRAGA, M. D., "Alternative Approaches to Traditional Mean-Variance Optimisation" in *Asset Management and Institutional Investors*, Ignazio Basile, Pierpaolo Ferrari (Eds.), Springer International Publishing, pp. 243-255, 2024

Returns-Based Style Analysis

BRAGA, M. D., "Returns-Based Style Analysis" in *Asset Management and Institutional Investors*, Ignazio Basile, Pierpaolo Ferrari (Eds.), Springer International Publishing, pp. 345-371, 2024

Performance Attribution

BRAGA, M. D., "Performance Attribution" in Asset Management and Institutional Investors., Ignazio Basile, Pierpaolo Ferrari (Eds.), Springer International Publishing, pp. 373-395, 2024

Asset Allocation Strategica: principi e metodi

BRAGA, M. D., "Asset Allocation Strategica: principi e metodi" in Manuale del Private Banker. VIII Edizione., P. Musile Tanzi (Ed.), Egea, chap. 3, pp. 47-74, 2022

Mini-Bonds: An Emerging Link in the Intermediation Chain in Europe

ANDERLONI, L., M. D. BRAGA, "Mini-Bonds: An Emerging Link in the Intermediation Chain in Europe" in New Frontiers in Entrepreneurial Finance Research., Anita Quas, Yan Alperovych, Cristiano Bellavitis, Ine Paeleman, Dzidziso Samuel Kamuriwo (Eds.), World Scientific Publishers, chap. 8, pp. 207-240, 2019

I corporate bonds

BRAGA, M. D., "I corporate bonds" in Corporate & Investment Banking., S.Monferrà, M.Cotugno, S.Mazzù (Eds.), Franco Angeli, 2017

Alternative Approaches to Traditional Mean-Variance Optimisation

BRAGA, M., "Alternative Approaches to Traditional Mean-Variance Optimisation" in Asset Management and Institutional Investors., I. Basile, P. Ferrari (Eds.), Springer International Publishing, chap. 6, pp. 203-213, 2016

Asset allocation strategica: principi e metodi

BRAGA, M., "Asset allocation strategica: principi e metodi" in Manuale del Private Banker. VII Edizione., P. Musile Tanzi (Ed.), Egea, chap. 3, pp. 63-90, 2016

Methods and Tools for Portfolio Selection

BRAGA, M., "Methods and Tools for Portfolio Selection" in Asset Management and Institutional Investors., I. Basile, P. Ferrari (Eds.), Springer International Publishing, chap. 5, pp. 173-201, 2016

Performance Attribution

BRAGA, M., "Performance Attribution" in Asset Management and Institutional Investors., I. Basile, P. Ferrari (Eds.), Springer International Publishing, chap. 9, pp. 301-323, 2016

Returns-Based Style Analysis

BRAGA, M., "Returns-Based Style Analysis" in Asset Management and Institutional Investors., I. Basile, P. Ferrari (Eds.), Springer International Publishing, chap. 8, pp. 277-300, 2016

Strategic Asset Allocation with Mean-Variance Optimisation

BRAGA, M., "Strategic Asset Allocation with Mean-Variance Optimisation" in Asset Management and Institutional Investors., I. Basile, P. Ferrari (Eds.), Springer International Publishing, chap. 4, pp. 97-172, 2016

Assett allocation strategica: principi e metodi

BRAGA, M. D., "Assett allocation strategica: principi e metodi" in Manuale del Private Banker. VI Edizione., P. Musile Tanzi (Ed.), Egea, chap. 3, pp. 59-86, 2013

Gli investimenti alternativi: il caso dei funds of hedge funds

BRAGA, M. D., "Gli investimenti alternativi: il caso dei funds of hedge funds" in L'innovazione finanziaria., Newfin - Centro Studi sull'Innovazione Finanziaria (Ed.), Bancaria Editrice, chap. 16, 2004

I corporate (defaultable) bonds

BRAGA, M. D., "I corporate (defaultable) bonds" in Economia del mercato mobiliare – Gestione dei portafogli obbligazionari., E.M. Carluccio (Ed.), CUSL, 2004

Il Value at Risk (VaR) per gli strumenti obbligazionari

BRAGA, M. D., "Il Value at Risk (VaR) per gli strumenti obbligazionari" in Economia del mercato mobiliare – Gestione dei portafogli obbligazionari., E.M. Carluccio (Ed.), CUSL, 2004

Mean variance efficiency: da Markowitz a...oggi

BRAGA, M. D., "Mean variance efficiency: da Markowitz a...oggi" in L'innovazione finanziaria., Newfin - Centro Studi sull'Innovazione Finanziaria (Ed.), Bancaria Editrice, chap. 17, 2004

I servizi agli investitori: gli strumenti delle gestioni collettive

BRAGA, M. D., "I servizi agli investitori: gli strumenti delle gestioni collettive" in Gli strumenti e i servizi finanziari., P.L. Fabrizi, G. Forestieri, P. Mottura (Eds.), Egea, 2003

L'analisi dello stile di investimento dei gestori e il multimanagement approach

BRAGA, M. D., E. CARLUCCIO, "L'analisi dello stile di investimento dei gestori e il multimanagement approach" in Il private banking – gestione del risparmio e della clientela: strategie, strumenti ed esperienze., A. Resti (Ed.), Bancaria Editrice, chap. 5, pp. 205-244, 2003

The Norwegian Experience: the Case of Den Norke Bank

BRAGA, M. D., "The Norwegian Experience: the Case of Den Norke Bank" in Banking Privatisation in Europe. The Process and the Consequences on Strategies and Organisational Structures., R. Ruozi, L. Anderloni (Eds.), Springer-Verlag, chap. 7, pp. 237-268, 1999

Edited Books

Asset management e investitori istituzionali. III Ed.

BASILE, I., P. FERRARI, M. D. BRAGA (Eds.), "Asset management e investitori istituzionali. III Ed." - 2024, Pearson Italia, Italy

Asset management e investitori istituzionali. Ediz. Mylab

BASILE, I., M. D. BRAGA, P. FERRARI (Eds.), "Asset management e investitori istituzionali. Ediz. Mylab" - 2019, Pearson Italia, Italy

New Frontiers in banking services – Emerging needs and tailored products for untapped markets

BRAGA, M. D., L. ANDERLONI, E. CARLUCCIO (Eds.), "New Frontiers in banking services – Emerging needs and tailored products for untapped markets" - 2007, Springer-Verlag, Berlin Heidelberg

Research Monographs

Il finanziamento delle startup e delle PMI: Un antico tema alla ricerca di nuove soluzioni

ANDERLONI, L., M. D. BRAGA - "Il finanziamento delle startup e delle PMI: Un antico tema alla ricerca di nuove soluzioni" - 2019, Pearson Italia, Italy

Risk-Based Approaches to Asset Allocation – Concepts and Practical Applications

BRAGA, M. - "Risk-Based Approaches to Asset Allocation – Concepts and Practical Applications" - 2016, Springer International Publishing

Il risk budgeting nell'asset management

BRAGA, M. D. - "Il risk budgeting nell'asset management" - 2008, Bancaria Editrice, Italy

Le metodologie di performance attribution nella gestione del risparmio

BRAGA, M. D., P. CUCURACHI - "Le metodologie di performance attribution nella gestione del risparmio" - 2005, Egea, Milano, Italy

Working Papers

Value at Risk Computation by means of Principal Component Analysis: the European Case

BRAGA, M. D. - "Value at Risk Computation by means of Principal Component Analysis: the European Case" - 2006, Newfin Working Paper, Milano, Italy

Research Reports

Le commissioni di incentivo: profili gestionali e organizzativi

BRAGA, M. D., P. CUCURACHI - "Le commissioni di incentivo: profili gestionali e organizzativi" - 2000, Università Commerciale Luigi Bocconi, Milano, Italy