

Gli interessi scientifici di Anna Millo sono prevalentemente rivolti alla storia delle élites economiche e imprenditoriali nell'Adriatico nord-orientale tra impero asburgico e Italia.

Il passaggio di Trieste - grande città europea e "primo porto" della monarchia austriaca - dall'Austria all'Italia e la difficile transizione del primo dopoguerra, dominato in tutta Europa dal nazionalismo economico, la stabilizzazione degli anni Venti, la "grande crisi" degli anni Trenta, le leggi razziali antisemite, una seconda guerra mondiale devastante per l'Europa con la successiva spartizione del continente in zone d'influenza e la nazionalizzazione delle imprese attive nei paesi dell'Est sono i temi al centro di queste ricerche. Il filone locale (Trieste come sede centrale di grandi compagnie assicurative), il filone "nazionale" (il loro divenire società italiane, passaggio in cui l'Italia diventa importante non tanto agli effetti del mercato assicurativo, ma soprattutto perché in Italia si giocano i loro destini finanziari), il filone internazionale (la crescita industriale sui mercati mondiali e la lotta per il loro controllo) sono analizzati nella loro stretta interazione.

Dato il ruolo di primo piano della componente ebraica nel capitale finanziario e assicurativo di origine triestina e mitteleuropea, grande importanza assumono in queste ricerche i percorsi di integrazione sociale degli ebrei e successivamente, negli anni Trenta del Novecento, le persecuzioni contro questa minoranza.

Un filone di ricerca esplorato negli ultimi anni riguarda la questione internazionale di Trieste tra gli anni 1945-1954, vista sotto la particolare angolatura dei rapporti tra il governo italiano e il contesto locale.

Tra il 2012 e il 2014 ha coordinato un gruppo di ricerca sulla storia delle Assicurazioni Generali dalle origini (1831) agli anni Duemila.