

Faculty Economics, Finance and Banking



Methodological Approaches to Financial Intelligence

Student: Filomena Paciello

Professor : Gerardo Iovane

PhD Research Project:

*Methodologies and Technologies of Intelligence
for Finance and Financial Computing*

Sentiment Analysis and Financial Intelligence

Era dell'Informazione e dell'Economia della Conoscenza: l'informazione necessita di essere governata per il bene pubblico *public goods* prima di ogni altra forma di governo dei fatti economici;

Fase di <<crisi dell'esogeneità>>: debolezza di strumenti liberamente attivabili e abbondanza di variabili determinate dal mercato;

Intelligence Finanziaria: ingloba tutte le branche del pensiero economico e consente, attraverso il ciclo strategico delle informazioni, di mirare a garantire un ordine economico.

Methodological Approaches to Financial Intelligence

- *Business Intelligence*
- *Banking Intelligence*
- *Financial Intelligence*

Sentiment Analysis and Financial Intelligence

• *Business Intelligence*

(BI) sistema di modelli, metodi, processi, tecniche e strumenti per la trasformazione di dati grezzi in informazioni utili per il processo di pianificazione strategica.

- Sistemi BI: raccolta memorizzazione, accesso e analisi dati aziendali per aiutare nel processo decisionale;
- Tecnologie BI: gestione di grandi quantità di dati non strutturati;
- Obiettivi BI: facile interpretazione di tali grandi volumi di dati, qualità dell'informazione, nuove opportunità e strategie di mercato.

Methodological Approaches to Financial Intelligence

• *Banking Intelligence*

(*BAI*) capacità di un'organizzazione bancaria di comprendere e utilizzare informazioni al fine di aumentare la propria performance.

-Attività, procedure e applicazioni BAI: Data Warehousing, Modeling, Tools for Extraction, Information Portals, Data Mining, Business Modeling etc..

Methodological Approaches to Financial Intelligence

- *Financial Intelligence*

(*FI*) sistema di raccolta di informazioni sulle questioni finanziarie degli enti di interesse, per comprendere la loro natura e le capacità e prevedere le loro intenzioni.

Methodological Approaches to Financial Intelligence

Metodologie d'Intelligence: caratteristiche

- Accuratezza: qualità dei dati e delle informazioni;
- Obiettività: assenza di precodizionamenti, creazione di un framework iniziale per annullare influenze;
- Utilità: coerenza con le necessità espresse dal livello decisionale, in un particolare contesto;
- Attualità: produzione di Intelligence attuale in tempi utili per l'applicazione dei risultati.

Methodological Approaches to Financial Intelligence

Tecniche d' Intelligence*

- Tecniche analitico strategiche
- Tecniche di analisi di clienti e concorrenti
- Tecniche di analisi dell'ambiente
- Tecniche di analisi dell'evoluzione
- Tecniche di analisi finanziaria

*dati macro e microeconomici

Methodological Approaches to Financial Intelligence

Tecniche d' Intelligence

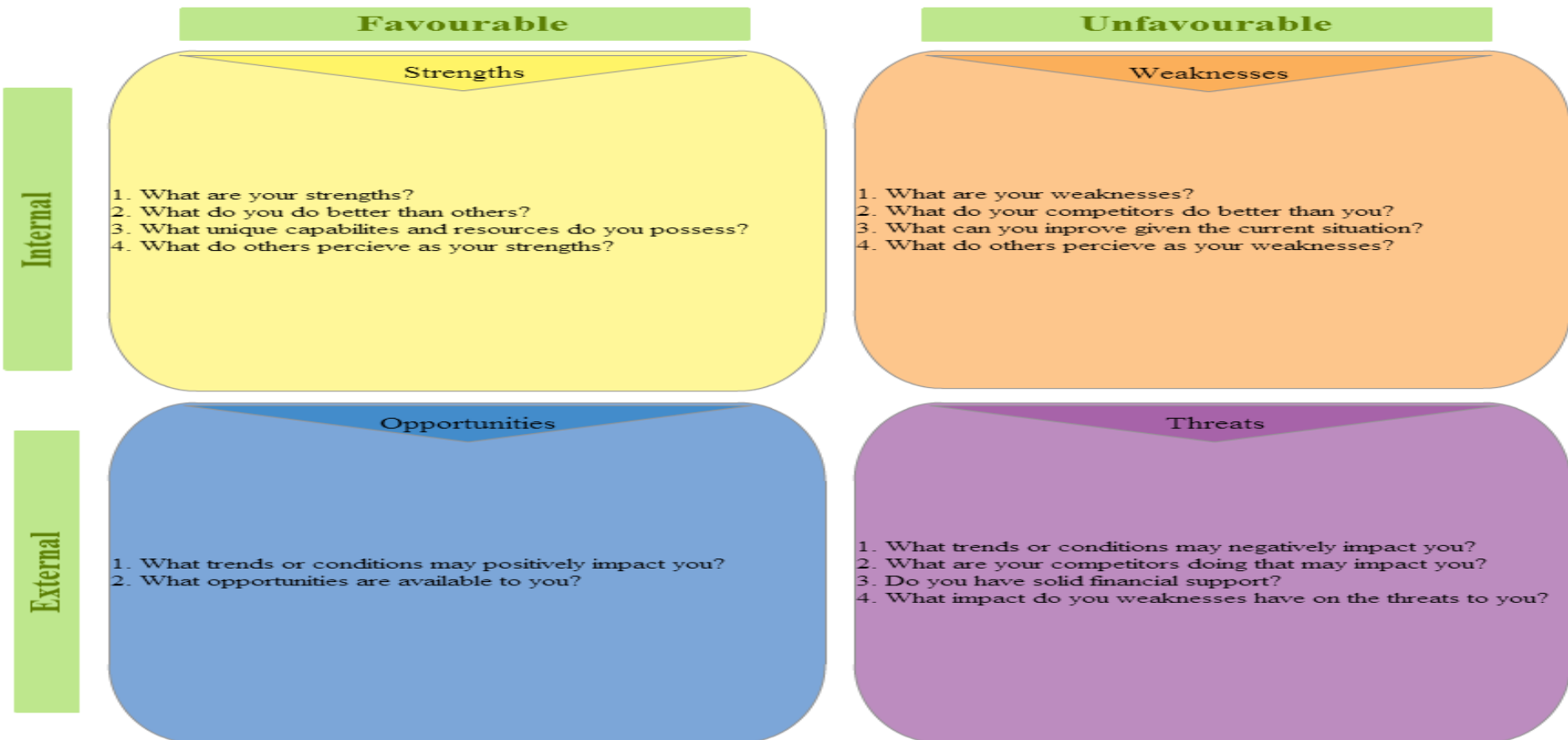
-Tecniche analitico strategiche: analisi delle capacità, delle caratteristiche e degli scopi di una organizzazione per una competitiva pianificazione strategica.

“SWOT analysis” e “PEST analysis”.

Methodological Approaches to Financial Intelligence

Tecniche analitico strategiche

SWOT analysis at Creately



Methodological Approaches to Financial Intelligence

Tecniche analitico strategiche

PEST analysis at Creately



PESTLE \subset Legal & Environmental

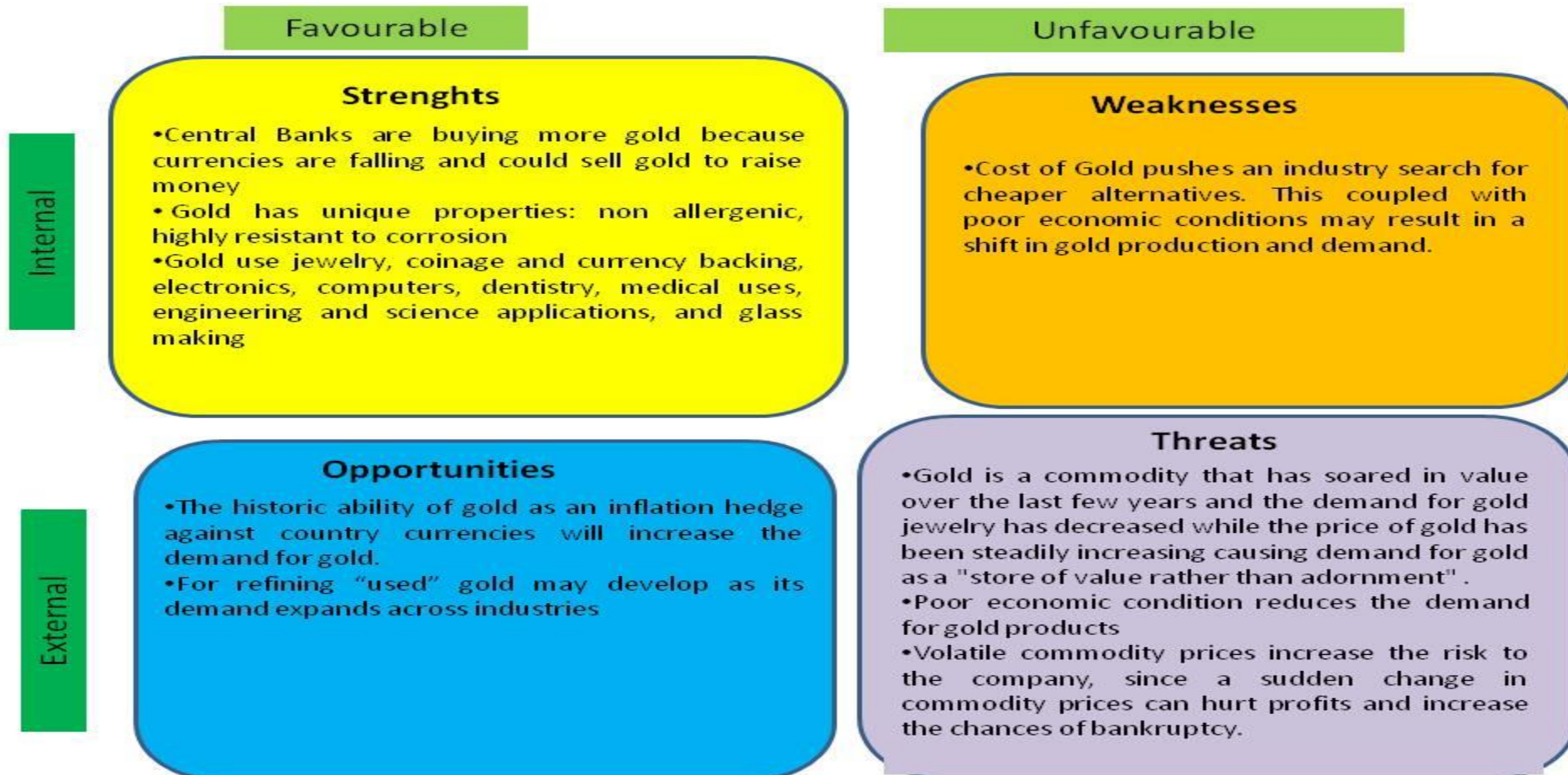
Methodological Approaches to Financial Intelligence

“The measure of intelligence is the ability to change.”

Albert Einstein

Methodological Approaches to Financial Intelligence

SWOT analysis GOLD*



Methodological Approaches to Financial Intelligence

PEST analysis PETROLEUM Italia, Basilicata*

Fattori Politici

- 2011 Memorandum di intesa Stato - Regione Basilicata per l'accelerazione dello Sviluppo regionale, la crescita occupazionale, l'incremento di infrastrutture e la realizzazione di interventi di ricerca e innovazione in relazione alla ricerca e coltivazioni di fonti fossili in Basilicata.
- Legge 164/2014 Sblocca Italia art'articolo 38 lo Stato avoca a se le determinazioni di politica energetica nazionale, ed in particolare le concessioni petrolifere

Fattori Economici

- Produzione 2014 kg. 3.978.719.492, circa 25 milioni di barili(prezzo petrolio 59.90 dollari al barile <127 kg>).
- Il giacimento petrolifero della Val d'Agri copre oggi il 6 per cento del fabbisogno nazionale, che si presume di incrementare al 10 per cento nel 2015 quando entrerà in produzione il giacimento Tempa Rossa.
- Euro 158.590.201,84 Gettito Royalties 2014

Fattori Sociali

- Rischio idrogeologico
- Incidenza tumori e malattie cardio respiratorie
- Siti contaminati dalle attività estrattive e dall'impatto esercitato da trivelle su invasi e sorgenti
- Incidenti e Inquinamento
- Mancanza di infrastrutture
- Tasso di disoccupazione costantemente in crescita

Fattori Tecnologici

Titoli Minerari Vigenti*

- 10 permessi di ricerca area km 1.358,61
- 20 concessioni di coltivazione area km 1.993,99
- 1 concessione si stoccaggio area km 48,16

* Aggiornamento al 31/05/2015

*dati Ministero dello Sviluppo Economico - Direzione Generale per le Risorse Minerarie ed Energetiche

Methodological Approaches to Financial Intelligence Criminology & Finance *

“7 GOLDEN W”

- 1) What happend? Cosa è successo?
- 2) When? Quando?
- 3) Where? Dove?
- 4) Whith What? Con che cosa?
- 5) Which Manner? In che maniera?
- 6) Why? Perché?
- 7) Who? Chi è stato?

*rapporti analisi tecnica con metodologie qualitative di intelligence Swot & Pest integrate con parametri quantitativi.

Methodological Approaches to Financial Intelligence

“The true sign of intelligence is not knowledge but imagination”

Albert Einstein

Methodological Approaches to Financial Intelligence

Bibliography

- America Carmine, *Servizi di informazione e intelligence economica a sostegno della competizione industriale Il ruolo strategico dei sistemi informativi per la conquista di nuove opportunità di mercato tra crisi economica e politica degli scenari multipolari*, Giugno 2014, Sistema di informazione per la sicurezza della Repubblica .
- Berman Karen, Knight Joe, *Financial Intelligence, Revised Edition: A Manager's Guide to Knowing What the Numbers really mean*, 2013, Harvard Business Review Press.
- Cuntactor, *L'Intelligence Economica e Decisione Politica*, 2012, Istituto Italiano Studi Strategici "Niccolo Machiavelli".
- Forestieri Giancarlo, *Corporate & Investment Banking*, 2009, Egea Editrice.
- Griscioli Giuseppe, *Competizione economico-finanziaria, ruolo dell'intelligence e sicurezza nazionale*, 2013, Aracne Editrice.
- Halby Emmanuel, *Intelligenza economica e tecniche sovversive. Le armi della nuova economia*, 2003, Franco Angeli Edizioni.
- Intelligence economico-finanziaria contro il 'virus' dei derivati*, Gnosis 3/2010 Rivista Italiana d'Intelligence .
- Jean Carlo, Savona Paolo, *Intelligence economica. Il ciclo dell'informazione nell'era della globalizzazione*, 2011, Rubettino Editore (collana Quaderni della Fondazione Intelligence Culture and Strategic Analysis ICSA).
- La finanza tra religione ed etica*, Gnosis 4/2009, Rivista Italiana d'Intelligence.
- Moinet Nicolas, *Intelligence Economica, Saggio di strategia preventiva*, 2013, a cura di Gagliano Giuseppe, Centro Studi Strategici Carlo De Cristoforis CESTUDEC Association.
- Moinet Nicolas, *Piccola storia della intelligence economica, Saggio di strategia economico-militare*, 2013, Centro Studi Strategici Carlo De Cristoforis CESTUDEC Association.
- Morbidelli Massimo, *Intelligence Economica e Competitività Nazionale*, Ottobre 2005, Centro Militare di Studi Strategici CeMiSS .
- Moss Larissa T., Shaku Atre, *Business Intelligence Roadmap: The Complete Project Lifecycle for Decision-Support Applications*, 2003, Addison-Wesley Professional.
- Mounteanu Adrian, Raduta Ovidiu, *Banking Intelligence Accelerator – Decision Support*, 2012, vol. III no. 2 Economic Informatics Department, Academy of Economic Studies Bucharest Romania.
- Musciandaro Donato, *Financial supervisory unification and financial intelligence units*, Vol. 8 Iss: 4, pp.354 – 370, 2005, Journal of Money Laundering Control .
- Lin Zhonglin, Beijing IBM China Res. Lab., Zhu Minghua, Yin Wenjun, Dong Jin, *Banking Intelligence: Application of data warehouse in bank operations*, Service Operations and Logistics, and Informatics, IEEE/SOLI volume 1, p. 143-146, 2008, IEEE International Conference .
- Walton Anne, *Financial Intelligence: Uses and Teaching Methods (Innovative Approaches from Subject Matter Experts)*, Supplement: Ninth Annual IAFIE Conference: Expanding the Frontiers of Intelligence Education Volume 6, pp. 393-400, 2013, The Journal of Strategic Security .

Methodological Approaches to Financial Intelligence

Courses

- Metodologie, Metodi, e Tecnologie per la Creazione, l'Ottimizzazione e la Gestione del Rischio di Portafogli Finanziari, 23, 24 , 25 luglio 2014, Università degli Studi di Salerno, Dipartimento di Ingegneria dell'Informazione, Ingegneria Elettrica e Matematica Applicata/DIEM - Prof. Massimo Ceccobelli.
- Le agenzie di rating - Consiglio Nazionale Forense presso il Ministero della Giustizia, 24 settembre 2014, Roma.

Lectures

- Sentiment Analysis and Financial Intelligence - Financial Computing: Methodologies, Methods and technologies for high performing financial trading, 13 novembre 2014, Financial Computing Research Group Università di Salerno.

Publications

- Paciello F., Iovane G., Ceci E., Sentiment Analysis and Financial Intelligence, Febbraio 2015, pp. 28-34, Traders Magazine Italia srl http://tradersonline-mag.com/01_ezine/01_traders/it/WEE/2015/02/index.html