

N. 22 - Un modello di machine learning per l'identificazione di aziende collegate alla criminalità organizzata in Italia

di Pasquale Cariello, Marco De Simoni e Stefano Iezzi



Classificazione JEL: C49, D22, E26, K42.

Parole chiave: criminalità organizzata, infiltrazione, riciclaggio, bilanci delle imprese, machine learning.

In questo studio viene sviluppato un algoritmo di *machine learning* per rilevare aziende potenzialmente collegate alla criminalità organizzata (CO). A questo scopo, si utilizza un *dataset* di imprese italiane ottenuto integrando informazioni finanziarie provenienti da varie fonti, tra cui principalmente dati di bilancio. Per addestrare e testare il modello, un campione di oltre 28.000 aziende italiane, caratterizzate da una elevata probabilità di essere collegate alla CO, viene confrontato con sottoinsiemi di aziende presumibilmente "sane" selezionati casualmente. I risultati ottenuti mostrano che, in fase di test, l'algoritmo identifica con successo circa il 76% delle aziende collegate alla CO (*recall*) e il 74% delle aziende presumibilmente "sane" (*specificity*). Il principale *output* dell'algoritmo è un punteggio di rischio, che potrebbe

essere utilizzato a livello operativo per supportare l'azione delle autorità anti-riciclaggio e delle forze dell'ordine (ad esempio, come strumento di *screening* preliminare). Conferme della sua validità operativa dovranno tuttavia venire da ulteriori applicazioni "sul campo".

UNITÀ DI INFORMAZIONE FINANZIARIA

Largo Bastia 35

00181 Roma

Centralino (Telefono): **+39 06 47921**

PEC (Posta elettronica certificata):

uif@pec.bancaditalia.it



Contatti

SITI CORRELATI

Banca d'Italia

**Ministero dell'economia e delle finanze -
Dipartimento del tesoro**

*Sezione dedicata alla prevenzione del
riciclaggio*

DIA

Direzione Investigativa Antimafia

GdF

Guardia di Finanza

EGMONT Group

Gruppo Egmont

Fondo Monetario Internazionale

*Sezione dedicata alle Financial Intelligence
Units*

GAFI - FATF

*Gruppo di Azione Finanziaria (GAFI) - Financial
Action Task Force (FATF)*

IMoLIN

*International Money Laundering Information
Network*

MoneyVal

*Committee of Experts on the Evaluation of Anti-
Money Laundering Measures and the Financing
of Terrorism*

SEGUICI SU



YouTube



X - Banca d'Italia



X - Ufficio stampa



LinkedIn



RSS



E-mail Alert

INFORMAZIONI LEGALI

- ▶ Privacy
- ▶ Preferenze cookie
- ▶ Disclaimer
- ▶ Copyright