

Random Tree based Committee Learning による企業収益リスクモデルの構築

神農康雄、鷺尾隆、矢田勝俊、元田浩、岡田孝

Modeling of Enterprise Profit Risk based on Random Tree Committee Learning

Yasuo SHINNOU, Takashi WASHIO, Katsutoshi YADA, Hiroshi MOTODA, and Takashi OKADA

東証一部上場企業の会計決算データを対象に、種々のデータマイニング手法を適用して次期の企業収益の増減を予測する企業収益リスクモデルを構築した。その結果、Random Tree based Committee Learning が最高精度出力モデルとなった。またそのモデル構築過程において、会計決算データの性質を明らかにし、企業収益を決定する会計上のリスク要因を考察した。

キーワード データマイニング、Random Tree、Committee Learning、リスク、企業収益