

マーケティング・リサーチにおける 統計的因果探索を用いた因果仮説構築に関する研究

データサイエンス研究科, 株式会社マクロミル
小西 伶児

2020 年 12 月 19 日

概要

本研究では,

目次

1	序論	2
1.1	研究背景	2
1.2	既存手法・研究	3
1.3	研究目的	4
1.4	本論文の構成	5
2	既存モデルとその識別可能性	6
2.1	数学的準備	6
2.2	LiNGAM	7
2.3	2 次分散関数 (QVF) DAG モデル	8
2.4	QVF-DAG モデルの識別可能性	9
3	提案モデル	12
3.1	提案モデル	12
3.2	提案モデルの識別可能性	13
	参考文献	17
	謝辞	17

1 序論

1.1 研究背景

企業は自社の商品やサービスを顧客に提供するために、様々なマーケティング活動を行っている。近年では消費者の嗜好が多様化したり、新型コロナウイルス感染症が流行したりするなど、企業活動を取り囲む環境が日々大きく変化しており、企業はその環境変化に適応する必要がある。それ故、商品・サービスの開発や消費者とのコミュニケーションなどのマーケティング活動を適切に実行するためには、消費者の行動について深く理解することがより一層重要となっている。

アメリカ・マーケティング協会 (AMA) によると、マーケティングの定義は「顧客、クライアント、パートナー、社会のための価値の創造、伝達、提供、交換という全体の活動」であり、マーケティング・リサーチは「消費者、顧客、公衆とマーケターが情報を介してつながる機能」であると定義している^{*1}。また、その具体的な業務として、「必要な情報を特定し、情報収集のための方法を設計し、データ収集プロセスを管理・実施し、結果を分析し、分析結果と結果から得られる示唆伝えること」としている。つまり、上記の定義を合わせて考えると、マーケティング・リサーチは「マーケティング課題の発見や施策の実行に必要なデータを適切に収集し、得られたデータを分析することで、企業のマーケティング活動を支援すること」と理解することができる。

企業のマーケティング活動は、主に以下の4つのフェーズに分類することが可能で、商品・サービスのカテゴリにも依存するが、約1～数年程度の期間で繰り返されることが一般的である。この繰り返しのことをマーケティング・サイクルと呼ぶ。

- 市場機会の発見
- コンセプト開発
- コミュニケーション内容・販売施策の策定
- 施策後の効果検証

マーケティング・リサーチは、各フェーズにおけるマーケティング担当者の関心事に対して、適切な示唆を与えることが求められている。「市場機会の発見」では、「市場にある商品で満たされていないニーズは何か？」や「この商品を購入している人はどのような特徴があるのか？」といったことが、マーケティング担当者の関心事となり、未充足ニーズの探索や、消費者セグメントの整理などがリサーチの役割となる。次に「コンセプト開発」では、「どのような価値を提供すると売れるのか？」や「ターゲットとなる消費者の規模はどのくらいか？」といったことが関心事となり、コンセプトの受容性確認や、消費者セグメントの規模感把握などがリサーチに求められる。また「コミュニケーション内容・販売施策の策定」では、「商品の特長をどのように伝えたと購買に結びつくのか？」や「商品パッケージや価格はどのようにすればよいのか？」といったことが主な関心事となり、広告内容の精査や、商品の改善点抽出などが行われる。最後に「施策後の効果検証」においては、市場浸透度の確認や、広告量などの投資に対する売上の費用対効果などが行われる。各フェーズでのマーケティング担当者の関心事を俯瞰すると、多くは「マーケティング活動と消費者行動の因果関係」にあると言える。

「マーケティング」の他に「ブランディング」も類似の意味を持つ言葉として頻繁に用いられるが、それぞれの言葉の意味には異なる部分が存在する。音部 (2019)[20] によると、マーケティングは属性の順位を変換して

^{*1} <https://www.ama.org/the-definition-of-marketing-what-is-marketing/>

市場を創造することを目指し、結果的にニーズを作り出すことにつながっており、ブランディングはブランドの意味の確立を目指し、結果的にベネフィットを作り出すことにつながっている。つまり、マーケティングは消費者行動の因果構造そのものを変化させることによって、自社の商品が有利に購買されるような状況を作り出す活動であることに對し、ブランディングは現在の消費者行動の因果構造はそのままに、自社の商品に対する消費者の認識を変化させ、自社の商品を購入することの必然性を高める活動であると捉えることができる。

このように企業は、自社の商品やサービスを顧客に効率的に提供するために、マーケティング・リサーチを通じて消費者に関する情報を収集・分析し、消費者行動の因果関係について仮説を立てたり解釈を行ったりしている。そのため、マーケティング・リサーチにおいて、消費者行動の因果関係に関する情報を得る手段は、非常に重要な役割を担っている。

1.2 既存手法・研究

因果関係に関する考察は、科学の基本的な問いとして因果推論という文脈で研究されてきた。また、計算機科学や統計科学の発展により、経済学やマーケティングの分野でも注目されている [10]。因果推論は大まかに、(i) 因果構造の同定、と (ii) 因果構造を既知としたその因果関係の大きさの推定、という 2 つの問題に分類できる。(i) 因果構造の同定 は、非常に困難な問題であるとされているが、いくつかの仮定の上で識別可能なモデルが提案されている。(ii) 因果構造を既知としたその因果関係の大きさの推定 は、ランダム化比較試験を中心とした実験研究と、特に実験を行わない観察研究の双方において統計科学の文脈で研究されている。

本節では、マーケティング・リサーチにおいて消費者行動の因果関係に関する情報を得る方法として従来より広く用いられてきた一般的な既存手法について述べた後、統計的因果探索と呼ばれる因果構造の同定に関する近年の研究について俯瞰する。

1.2.1 マーケティング・リサーチにおける既存手法

マーケティング・リサーチにおいて消費者行動の因果関係に関する情報を得る方法は、大きく定性調査と定量調査に分類される。

定性調査は一般的に、消費者の内部にある意見や態度を理解することで、マーケティング課題の詳細な定義、仮説の設定、調査項目の優先順位の決定、消費者独自の考え方や表現の理解、企業のマーケティング担当者の不足している知識の吸収、定量調査における最重要な項目に関する示唆を得るなどの目的で実施される [16]。主に深層面接法 (デプス・インタビュー) や集団面接法 (グループ・インタビュー) といった、インタビュアーが回答者との対話を通じて質問をし回答を得る方法が一般的である。そのため、調査対象者が日常生活であまり気に留めていないことや、誰かに問いかけられて初めて気づくことなどを収集することができ [16]、マーケティング担当者の周辺知識では想定しきれなかった因果関係を発見できる可能性がある。一方で、定性調査は定量調査と比べて一般的に時間や費用が多くかかることや、定量的な評価ができず、得られた意見や行動の一般性・代表性に関する議論ができないことなどのデメリットがある。

定量調査では、主にアンケート調査に代表される意識データや、POS データ、ID 付き POS データ、位置情報などの行動データが用いられる。これらのデータの分析手法は非常に多岐に渡るが、消費者行動の因果関係を評価する手法としては、一般化線形モデル (generalized linear model, GLM) や構造方程式モデル (structural equation model, SEM) を用いることが多い [14][18]。GLM では、目的変数と説明変数の関係を定式化し、各係数を目的変数に対する説明変数の因果関係の大きさとして解釈を行うことが慣例となっている。しかし、宮川 (2004) [15] で述べられている通り、GLM は説明変数を与えたときの目的変数の条件付き確

率分布に関するモデルであり、多変量の相関関係を利用しているに過ぎず、その係数に対して因果的な解釈を行うことは誤りとなる可能性がある。一方で、SEM はデータの生成過程を記述した統計的因果モデルであり、その係数は単なる相関関係の尺度ではなく、因果的な解釈を行うことができる [15]。ただし、SEM は分析者の事前知識を積極的に利用することで因果構造の仮説を有向グラフで表現した上で、その構造に対してモデリングを行う手法である。つまり、SEM は上述の (ii) 因果構造を既知としたその因果関係の大きさの推定を行う手法であると言える。そのため、因果構造の仮説構築は分析者側の事前知識の質や量に依存し、妥当だと思われるモデルを得るまでに長い時間を要したりしているという現状がある。また、近年の社会の発展により消費者の行動は複雑化しているため、因果構造に関する仮説を構築することが難しい場合も少なくない。

1.2.2 統計的因果探索

統計的因果探索とは、因果構造が未知である際に、どのような条件で観測データから因果構造が復元することが可能であるかを明らかにする学問分野である。

以下の内容あたりをまとめる。

- 忠実性を仮定すると、条件付き独立関係からマルコフ同値類まで探索することができる
- 関数形や誤差分布などに仮定を置くと、因果構造が一意に復元可能なモデルが提案されている (LiNGAM などの ANM)
- ほとんどの既存手法は、データがすべて離散かすべて連続を仮定している
- カウントデータを仮定したモデルとして Park and Raskutti(2015)[4]
- それを拡張する方法などとして、Park and Raskutti(2017)[5] や、Park and Park(2019)[3]
- 連続・離散混在のモデルとして、Wenjuan *et al.*(2018)[11] や、Li and Shimizu(2018)[2] や、Yamayoshi *et al.*(2020)[12] など

1.3 研究目的

本研究の目的は、統計的因果探索の手法を応用し、マーケティング・リサーチにおいて消費者行動の因果構造に関する仮説を構築する手法の開発を行うことである。マーケティング・リサーチで扱う定量データは、先述のようにアンケート調査データや、POS データ、ID 付き POS データなどが中心である。特にアンケート調査データには、聴取内容に応じて様々な尺度のデータが含まれており、離散変数と連続変数の両方が混在している。

以下のような例を表にまとめる

- 知ってる/知らない などの 01 データ
- 最もよく買うブランドはどれか? などの名義尺度 (ダミー変数に変換して分析)
- あてはまる～あてはまらない のようなリッカート尺度 (連続変数とみなすことが多い)
- 購買頻度 (毎日買う/週 1 以上/月 1 以上) のような順序尺度 (もともとはカウントデータ)

そこで、本論文では離散変数と連続変数の両方が含まれる構造的因果モデルを提案し、その因果構造の識別可能性を議論する。

1.4 本論文の構成

最後にまとめて書く

2 既存モデルとその識別可能性

本章ではまず、本論文で用いる数学記号を導入し、非巡回有向グラフ (Directed Acyclic Graph, DAG) モデルとその識別可能性を定義する。その後、本論文の提案モデルを構成する 2 つの既存モデルについて概説する。既存モデルの 1 つ目は、連続変数を扱う DAG モデルで、Shimizu *et al.*(2006)[7] によって提案された線形非ガウス非巡回モデル (Linear Non-Gaussian Acyclic Model; LiNGAM) である。2 つ目は、主に離散変数を扱う DAG モデルで、Park and Raskutti(2017)[5] によって提案された 2 次分散関数 (Quadratic Variance Function, QVF) DAG モデルである。QVF-DAG モデルの識別可能性は、Park and Raskutti(2017)[5] によって過分散スコアを用いて証明されたが、本論文では Park and Park(2019)[3] が提案したモーメント比スコアを拡張することで、識別可能条件の緩和を行う。

2.1 数学的準備

グラフは頂点 (node) の集合 $V = \{1, 2, \dots, p\}$ と、頂点同士をつなぐ辺 (edge) の集合 $E \subset V \times V$ によって、 $G = (V, E)$ と表現される。グラフの辺は有向辺 (矢線) と無向辺 (双方向矢線) に分けることができ、2 つの頂点 $j, k \in V$ において、 $(j, k) \in E$ かつ $(k, j) \notin E$ のとき、 j から k への矢線があるという。これを $j \rightarrow k$ と表現することもある。一方で、 $(j, k) \in E$ かつ $(k, j) \in E$ のとき、 j と k の間に双方向矢線があるという。すべての辺が有向辺であるグラフを有向グラフ (directed graph) という。本論文では、特に断りのない限り、頂点 j から k への矢線がある場合、 j が k の原因であるといった因果関係があることを表すとする。つまり、本論文で扱うグラフにおける矢線の有無は因果関係の有無を表しており、矢線の始点が原因で、矢線の終点が結果である。このような定性的な因果関係を表すグラフを因果グラフ (causal graph) という。また、グラフ G からすべての矢印を取り除くことによって得られるグラフを G のスケルトンという。

頂点の系列 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_{n+1}$ について、すべての $i = 1, 2, \dots, n$ で、 $\alpha_i \rightarrow \alpha_{i+1}$ 、または $\alpha_{i+1} \rightarrow \alpha_i$ となる矢線がある時、長さ n の道 (path) という。特に、すべての $i = 1, 2, \dots, n$ で、 $\alpha_i \rightarrow \alpha_{i+1}$ となる矢線がある時、長さ n の有向道 (directed path) という。また、長さ n の有向道で、 $\alpha_1 = \alpha_{n+1}$ となるものを巡回閉路 (cycle) という。一方で、巡回閉路のない有向グラフは非巡回的 (acyclic) であるという。本論文では、非巡回有向グラフ (Directed Acyclic Graph; DAG) のみを扱う。

頂点 j から k への矢線がある時、 j を k の親 (parent) といい、 k を j の子 (child) という。また、 $(j, k) \in E$ であるすべての頂点 j からなる集合を $Pa(k)$ と表記する。頂点 j から k への有向道がある時、 j を k の祖先 (ancestor)、 k を j の子孫 (descendant) という。頂点 k のすべての祖先からなる集合を $An(k)$ 、すべての子孫からなる集合を $De(k)$ と表記する。また、すべての頂点から k と k の子孫を除いたものを、 k の非子孫 (non-descendant) といい、その集合を $Nd(k) \equiv V \setminus (\{k\} \cup De(k))$ と表記する。さらに、因果的順序 (causal ordering) について定義する。因果的順序とは、その順序に従って変数を並び替えると、すべての矢線 $(j, k) \in E$ について、 k が j の原因になることがない順序のことであり、 $\pi = (\pi_1, \dots, \pi_p)$ と表記する。DAG で表現される因果グラフには、このような順序が (一意とは限らないが) 存在するという特徴がある。つまり、因果グラフを同定することは、因果的順序を同定することとスケルトンを同定することという 2 つの工程に分解することができる。

有向グラフ G における頂点上の標本空間 \mathcal{X}_V の確率分布に従う確率変数の集合 $X \equiv (X_j)_{j \in V}$ について考える。ここで、確率変数ベクトル X は、同時確率密度関数 $f_G(X) = f_G(X_1, X_2, \dots, X_p)$ で与えられている

と仮定する。\$V\$ の任意の部分集合 \$S\$ について、\$X_S \equiv \{X_j : j \in S \subset V\}\$ と \$\mathcal{X}_S \equiv \times_{j \in S} \mathcal{X}_j\$ を定義する。ただし、\$\mathcal{X}_j\$ は \$X_j\$ の確率空間である。また、任意の頂点 \$j \in V\$ について、確率変数ベクトル \$X_S\$ を与えたときの変数 \$X_j\$ の条件付き確率を \$f_j(X_j|X_S)\$ と表記する。すると、DAG \$G\$ によるモデルは以下のように因数分解することができる [6]。

$$f_G(X) = f_G(X_1, X_2, \dots, X_p) = \prod_{j=1}^p f_j(X_j|X_{Pa(j)}) \quad (1)$$

ここで、\$f_j(X_j|X_{Pa(j)})\$ は、\$X_j\$ の親変数 \$X_{Pa(j)} \equiv \{X_k : k \in Pa(j) \subset V\}\$ を与えた条件付き確率である。

また、本論文では観測データから因果グラフを同定するという問題を扱うため、因果グラフの識別可能性について定義する。識別可能性を直感的に説明すると、条件付き確率分布 \$f_j(X_j|X_{Pa(j)})\$ に対してある仮定を置くと、同時確率密度関数 \$f_G(X)\$ を与えた DAG \$G\$ の構造を一意に決定付けることができるということである。

識別可能性について詳細に定義するために、すべての \$j \in V\$ に関する条件付き確率分布 \$f_j(X_j|X_{Pa(j)})\$ の集合を \$\mathcal{P}\$ と表記する。また、グラフ \$G = (V, E)\$ について、グラフ \$G\$ に関する同時分布のクラスと、分布 \$\mathcal{P}\$ のクラスを以下で定義する。

$$\mathcal{F}(G; \mathcal{P}) \equiv \{f_G(X) = \prod_{j \in V} f_j(X_j|X_{Pa(j)}); \text{ where } f_j(X_j|X_{Pa(j)}) \in \mathcal{P} \quad \forall j \in V\} \quad (2)$$

続いて、\$p\$ 個の変数からなる非巡回的有向グラフの集合を \$\mathcal{G}_p\$ と表記する。そこで、DAG \$\mathcal{G}_p\$ の空間上の確率分布のクラス \$\mathcal{P}\$ における識別可能性を以下のように定義する。

定義 2.1 (識別可能性). 条件付き分布のクラス \$\mathcal{P}\$ が \$\mathcal{G}_p\$ において識別可能であるとは、\$G, G' \in \mathcal{G}_p\$ において \$G \neq G'\$ であるならば、\$f_G = f_{G'}\$ を満たすような \$f_G \in \mathcal{F}(G; \mathcal{P})\$ と \$f_{G'} \in \mathcal{F}(G'; \mathcal{P})\$ が存在しないことである。

2.2 LiNGAM

本節では、連続変数データから因果構造を推定するモデルとして、LiNGAM[7] について概説する。

LiNGAM は、観測データが DAG によって表現されるデータ生成過程から生成されるものと仮定する。\$p\$ 個の観測変数 \$X = \{X_1, \dots, X_p\}\$ に対する LiNGAM は以下のように書ける。

$$X_j = e_j + b_{j0} + \sum_{k \in Pa(j)} b_{jk} X_k \quad \text{with} \quad e_j \sim \text{non-Gaussian} \quad (3)$$

各観測変数 \$X_j\$ は、その変数以外の観測変数 \$X_k\$ とその誤差変数 \$e_j\$ の線形和である。また、それぞれの係数 \$b_{jk}\$ は、変数 \$X_k\$ から変数 \$X_j\$ への直接的な因果効果の大きさを表す。加えて、誤差変数 \$e_j\$ はすべて平均 0、分散非ゼロの非ガウス分布に従う連続確率変数であり、お互いに独立であることを仮定する。つまり、潜在交絡変数が存在しないことを仮定する [9]。

LiNGAM は Shimizu *et al.*(2006)[7] によって、因果グラフとグラフを構成するパラメータが一意に識別可能であることが証明されている。

2.3 2 次分散関数 (QVF) DAG モデル

本節では、主に離散変数を扱う DAG モデルとして、Park and Raskutti(2017)[5] によって提案された 2 次分散関数 (QVF) DAG モデルについて概説する。QVF-DAG モデルは、各頂点の親による条件付き分布 \mathcal{P} の分散が、平均の 2 次式で与えられているというモデルであり、以下のように定義される。

定義 2.2 (QVF-DAG モデル [5]). 2 次分散関数 (Quadratic variance function, QVF) DAG モデルは、各頂点の親による条件付き確率分布が、以下で表現される 2 次分散関数性 (quadratic variance function property) を満たすような DAG モデルである。

すべての $j \in V$ について、以下を満たすような $\beta_{j0}, \beta_{j1} \in \mathbb{R}$ が存在する。

$$\text{Var}(X_j | X_{Pa(j)}) = \beta_{j0} E(X_j | X_{Pa(j)}) + \beta_{j1} E(X_j | X_{Pa(j)})^2 \quad (4)$$

QVF 確率分布のクラスには、ポアソン分布、二項分布、負の二項分布、ガンマ分布などが含まれることが知られている。DAG モデルにおいては、各頂点の分布がその頂点の親変数の影響を受けており、各頂点の条件付き期待値は、任意の単調で微分可能なリンク関数 $g_j: \mathcal{X}_{Pa(j)} \rightarrow \mathbb{R}^+$ によって、 $E(X_j | X_{Pa(j)}) = g_j(X_{Pa(j)})$ で表現される。

また、本論文の後半では、各頂点間の関係について線形性を仮定するため、QVF-DAG モデルの特殊系として、QVF 構造方程式モデル (structural equation model, SEM) を導入する。QVF-SEM は、リンク関数 g_j がパラメータに関して線形であることを仮定したものである。

$$g_j(X_{Pa(j)}) = \theta_j + \sum_{k \in Pa(j)} \theta_{jk} X_k \quad (5)$$

ここで、 $(\theta_{jk})_{k \in Pa(j)}$ は親変数の重み付け係数である。例えば、ある頂点の条件付き確率分布がポアソン分布の場合、 $g_j(X_{Pa(j)}) = \exp(\theta_j + \sum_{k \in Pa(j)} \theta_{jk} X_k)$ となる。

より一般的には、指数分布族の定義を用いて、以下のように表現することができる。

$$P(X_j | X_{Pa(j)}) = \exp \left(\theta_{jj} X_j + \sum_{(k,j) \in E} \theta_{jk} X_k X_j - B_j(X_j) - A_j \left(\theta_{jj} + \sum_{(k,j) \in E} \theta_{jk} X_k \right) \right) \quad (6)$$

ここで、 $A_j(\cdot)$ は対数分配関数 (log-partition function)、 $B_j(\cdot)$ は指数分布族によって決まる関数、 $\theta_{jk} \in \mathbb{R}$ は頂点 j に対応するパラメータである。DAG モデルの因数分解 (1) 式により、QVF-DAG モデルの同時確率分布は、以下のように記述することができる。

$$P(X) = \exp \left(\sum_{j \in V} \theta_{jj} X_j + \sum_{(k,j) \in E} \theta_{jk} X_k X_j - \sum_{j \in V} B_j(X_j) - \sum_{j \in V} A_j \left(\theta_{jj} + \sum_{(k,j) \in E} \theta_{jk} X_k \right) \right) \quad (7)$$

このモデルは、各条件付き分布がそれぞれ異なる分布に従っているような混合 DAG モデルにも拡張することが可能である。また、各頂点の分布 \mathcal{P} が (4) 式で定義される 2 次分散関数性を満たす場合、非線形モデルやノンパラメトリックモデルに拡張することも可能である。

2.4 QVF-DAG モデルの識別可能性

本節では QVF-DAG モデルが識別可能であることを証明する。QVF-DAG モデルの識別可能性は Park and Raskutti(2017)[5] によって初めて証明されたが、本論文では Park and Park(2019)[3] のアイデアを用いることにより、識別可能条件の緩和も行う。

Park and Park 2019 の方針で証明する意義付けを明確にする必要あり…

まず初めに、QVF-DAG モデルにおけるモーメント (積率) について以下のような関係性が成立していることを示し、識別可能性の証明に利用する。

命題 2.3. リンク関数 $(g_j(X_{Pa(j)}))_{j \in V}$ が非退化である QVF-DAG モデル (4) において、任意の頂点 $j \in V$ 、任意の集合 $S_j \subset Nd(j)$ に関して、以下のモーメント関係が成立している。

$$\frac{E(X_j^2)}{E[\beta_0 E(X_j|X_{S_j}) + (\beta_1 + 1)E(X_j|X_{S_j})^2]} \geq 1 \quad (8)$$

同様に、

$$E(\text{Var}(E(X_j|X_{Pa(j)}))|X_{S_j}) \geq 0 \quad (9)$$

等号成立は、 S_j が頂点 j の親変数すべてを含むとき ($Pa(j) \subset S_j$) である。

証明. 分散とモーメントの関係性と、2 次分散関数性の定義を利用すると、2 次分散関数性を満たす確率変数 X のモーメントについて、以下の関係性が成り立つ。

$$\begin{aligned} \text{Var}(X) &= E(X^2) - E(X)^2 && \text{分散の公式より} \\ &= \beta_0 E(X) + \beta_1 E(X)^2 && \text{2 次分散関数性の定義より} \end{aligned}$$

よって、

$$E(X^2) = \beta_0 E(X) + (\beta_1 + 1)E(X)^2$$

ここで、記号の簡単のために、 $f(\mu) = \beta_0 \mu + (\beta_1 + 1)\mu^2$ と関数を定義する。すると、任意の頂点 $j \in V$ 、任意の空でない集合 $S_j \subset Nd(j)$ について、以下のように書ける。

$$\begin{aligned} E(X_j^2|S_j) &= E(E(X_j^2|X_{Pa(j)})|S_j) \\ &= E(f(E(X_j|X_{Pa(j)}))|S_j) \end{aligned} \quad (10)$$

イェンセンの不等式と関数 $f(\cdot)$ が凸であることを利用すると、以下が導ける。

$$\begin{aligned} E(f(E(X_j|X_{Pa(j)}))|S_j) &\geq f(E(E(X_j|X_{Pa(j)}))|S_j) \\ &= f(E(X_j|S_j)) \end{aligned} \quad (11)$$

ここで、モデルの定義より、 $E(X_j|X_{Pa(j)}) = g_j(X_{Pa(j)})$ であり、関数 $g_j(\cdot)$ は非退化であることを利用すると、等号は S_j が頂点 j の親変数すべてを含むとき ($Pa(j) \subset S_j \subset Nd(j)$) のみ成立する。

式 (10) と式 (11) を整理すると、

$$\begin{aligned} E(X_j^2|S_j) - f(E(X_j|S_j)) &\geq 0 \\ E(X_j^2|S_j) - (\beta_0 E(X_j|S_j) + (\beta_1 + 1)E(X_j|S_j)^2) &\geq 0 \end{aligned}$$

となり、さらに期待値を取ること、

$$E(X_j^2) - E(\beta_0 E(X_j|S_j) + (\beta_1 + 1)E(X_j|S_j)^2) \geq 0$$

が得られる。よって、以下が成り立つ。

$$\frac{E(X_j^2)}{E(\beta_0 E(X_j|S_j) + (\beta_1 + 1)E(X_j|S_j)^2)} \geq 1$$

ここからは、 $E(X_j^2) \geq E(\beta_0 E(X_j|S_j) + (\beta_1 + 1)E(X_j|S_j)^2)$ が、 $E(\text{Var}(E(X_j|X_{Pa(j)})|X_{S_j})) \geq 0$ と同値であることを証明する。分散の公式を用いると… 後ほど書く… \square

直感的な理解を得るために、各頂点の親変数による条件付き確率分布がポアソン分布である 2 変数 DAG モデルを例にその識別可能性を証明する。そこで、図 1 のような DAG モデルを考える。

- $G_1: X_1 \sim \text{Poisson}(\lambda_1), \quad X_2 \sim \text{Poisson}(\lambda_2)$ ただし、 X_1 と X_2 は独立
 - $G_2: X_1 \sim \text{Poisson}(\lambda_1), \quad X_2|X_1 \sim \text{Poisson}(g_2(X_1))$
 - $G_3: X_2 \sim \text{Poisson}(\lambda_2), \quad X_1|X_2 \sim \text{Poisson}(g_1(X_2))$
- ただし、 g_1 と g_2 は非退化な任意の関数である。 $(g_1, g_2: \mathbb{N} \cup \{0\} \rightarrow \mathbb{R}^+)$

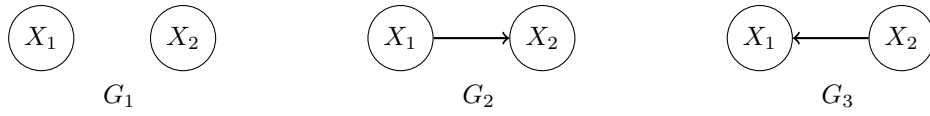


図 1 2 変数の Poisson-DAG モデル

命題 2.3 より、 G_1 におけるすべての頂点 $j \in \{1, 2\}$ について、 $E(X_j^2) = E(X_j) + E(X_j)^2$ である。 G_2 においては、以下が成り立つ。

$$E(X_1^2) = E(X_1) + E(X_1)^2, \quad \text{and} \quad E(X_2^2) > E(X_2) + E(X_2)^2$$

同様に、 G_3 においては、以下が成り立つ。

$$E(X_1^2) > E(X_1) + E(X_1)^2, \quad \text{and} \quad E(X_2^2) = E(X_2) + E(X_2)^2$$

つまり、モーメント比 $E(X_j^2)/(E(X_j) + E(X_j)^2)$ によって、真のグラフ構造を同定することが可能である。

命題 2.3 のモーメント比を用いる方法は、一般的な p 変数の QVF-DAG モデルにも適用することが可能であり、モーメント比 (8) が 1 か 1 以上かを確かめることで識別可能性を証明することができる。

定理 2.4 (QVF-DAG モデルの識別可能性). 2 次分散関数性を満たす係数 $(\beta_{j0}, \beta_{j1})_{j=1}^p$ が存在し、QVF-DAG モデル (1) のクラスについて考える。任意の頂点 $j \in V$ について、 $\beta_{j1} > -1$ であり、リンク関数 $g_j(\cdot)$ が非退化であるならば、QVF-DAG モデルは識別可能である。

証明. 一般性を失わずに、真の因果順序が一意であり、 $\pi = (\pi_1, \dots, \pi_p)$ であると仮定する。また、簡単のために、 $X_{1:j} = (X_{\pi_1}, X_{\pi_2}, \dots, X_{\pi_j})$ 、 $X_{1:0} = \emptyset$ と定義する。加えて、モーメント関連関数 $f(\mu) = \beta_0 \mu + (\beta_1 + 1)\mu^2$ を定義する。ここから数学的帰納法を用いて QVF-DAG モデルの識別可能性を証明する。

Step(1)

因果順序が最初である π_1 について、命題 2.3 を用いると、 $E(X_{\pi_1}^2) = E(f(E(X_{\pi_1})))$ であるのに対し、任意の頂点 $j \in V \setminus \{\pi_1\}$ については、 $E(X_j^2) > E(f(E(X_j)))$ である。よって、因果順序が 1 番目の要素 π_1 を特定することができる。

Step(m-1)

因果順序が $(m-1)$ 番目の要素について、因果順序が先の $m-1$ 個の要素とその親が正しく推定されていると仮定する。

Step(m)

因果順序が m 番目の要素とその親について考える。命題 2.3 より、 π_m は、 $E(X_{\pi_m}^2) = E(f(E(X_{\pi_m}|X_{1:(m-1)})))$ である。

一方で、 $j \in \{\pi_{m+1}, \dots, \pi_p\}$ については、 $E(X_j^2) > E(f(E(X_j|X_{1:(m-1)})))$ である。よって、因果順序が m 番目の要素 π_m を推定することができる。

親変数に関しては、 $P(G)$ の因数分解 (1) による以下の条件付き独立関係より導くことができる。

$$\begin{aligned} E(X_{\pi_m}^2) &= E(f(E(X_{\pi_m}|X_{1:(m-1)}))) \\ &= E(f(E(X_{\pi_m}|X_{Pa(\pi_m)}))) \end{aligned}$$

つまり、上記の関係が成立するような最小の集合を $X_{1:(m-1)}$ の中から π_m の親として選択することができる。

□

Park and Raskutti(2017)[5] によって証明された QVF-DAG モデルの識別可能条件には、 $Pa(j) \not\subseteq S_j$ のとき、すべての $x \in \mathcal{X}_{S_j}$ について、 $Var(E(X_j|X_{Pa(j)})|X_{S_j} = x) > 0$ という仮定が含まれていた。しかし、本論文における識別可能条件にはそのような仮定は含まれていない。つまり、従来の識別可能条件 [5] を緩和している。この識別可能条件の緩和によって Poisson-SEM の学習が容易になることが、Park and Park(2019)[3] の 3.2 節において議論されている。

3 提案モデル

本章では前章で俯瞰した2つのモデル [7][5] を用いることによって、連続変数と離散変数が混在するデータにおける DAG モデルを提案し、その識別可能性を証明する。その後、提案モデルを推定する手法について述べる。

3.1 提案モデル

提案モデルにおける変数は、離散変数と連続変数に分けられ、離散変数は0以上の整数を取る確率変数であると仮定する。そこで提案モデルを以下のように定義する。

定義 3.1 (提案モデル). p 個の観測変数 $X = \{X_1, \dots, X_p\}$ は DAG によって表現されるデータ生成過程から生成されており、各変数の親変数がその変数の直接的な原因である。また、 p 個の観測変数 $X = \{X_1, \dots, X_p\}$ は、連続変数 ($X_j \in \mathbb{R}$) か離散変数 ($X_j \in \{0, \mathbb{N}\}$) のいずれかに割り当てられ、それぞれ以下のデータ生成過程により生成されている。

1. 連続変数に割り当てられた変数 X_j は、その親変数 $Pa(j)$ と誤差変数 e_j の線形和である。

$$X_j = e_j + \theta_j + \sum_{k \in Pa(j)} \theta_{jk} X_k \quad \text{with } e_j \sim \text{non-Gaussian} \quad (12)$$

それぞれの係数 θ_{jk} は、変数 X_k から変数 X_j への直接的な因果効果の大きさを表す。また、誤差変数 e_j は非ガウス分布に従う確率変数であり、お互いに独立である。

2. 離散変数に割り当てられた変数 X_j は、その親変数 $Pa(j)$ による条件付き確率が、2次分散関数性を満たす。つまり、以下を満たすような $\beta_{j0}, \beta_{j1} \in \mathbb{R}$ が存在する。

$$\text{Var}(X_j | X_{Pa(j)}) = \beta_{j0} E(X_j | X_{Pa(j)}) + \beta_{j1} E(X_j | X_{Pa(j)})^2 \quad (13)$$

また、各変数の条件付き期待値は、その変数の親変数 $Pa(j)$ と任意の単調で微分可能なリンク関数 $g_j: \mathcal{X}_{Pa(j)} \rightarrow \mathbb{R}^+$ によって以下のように記述される。ただし、全ての $k \in Pa(j)$ について $|\theta_{jk}| > 0$ とする。

$$E(X_j | X_{Pa(j)}) = g_j(X_{Pa(j)}) = g_j \left(\theta_j + \sum_{k \in Pa(j)} \theta_{jk} X_k \right) \quad (14)$$

ここで、モデルの解釈性を優先させるため、リンク関数 g_i はパラメータ θ に関して線形な関数であることを仮定しているが、以降の識別可能性の議論などではそのような仮定は必要ではない。

マーケティング・リサーチの文脈において、上記のような因果モデルが有用であると考えられるかについて述べる。まず第一に、消費者行動の研究のうち、「消費者の知覚、選好および選択」を扱った分野との親和性である。消費者の知覚・選好・選択モデルは、消費者がどのようにブランドを理解し、そのブランドに対してどのような態度形成を経て購買に至るかをモデル化したものであり、具体的には「選好回帰分析」や「コンジョイント分析」といった手法によって分析が行われる [19]。これらの分析の基礎的な考え方に「多属性態度モデ

ル」が採用されており、それは以下のように表される。

$$U_j = a_1 z_{1j} + a_2 z_{2j} + \cdots + a_l z_{lj} \quad (15)$$

ここで、 U_j は対象 j に対する態度、 z_{ij} を対象 j の第 i 属性の水準、 a_i を第 i 属性に対する消費者の重視度である。例えば、ペットボトル入りの緑茶飲料に対する購入意向(態度)を、苦み・渋み・甘みなどの消費者が感じる味覚の良し悪し(属性の水準)と、各属性に対する消費者の重視度の線形加重和で表そうとするモデルである。本論文の提案モデルにおける連続変数のデータ生成過程の定義である式(12)は、選好回帰分析やコンジョイント分析が前提としている考え方を表現していると言える。通常、 U_j や z_{ij} のデータは、2～7段階尺度(「あてはまる」～「あてはまらない」など)で評価したデータが用いられる[19][16]。これらのデータは本来連続量である態度や評価を便宜的にいくつかの段階に分割した順序付きカテゴリカルデータであり、通常、各カテゴリに等間隔の数値を割り当て、割り当てられた値自体をデータとして回帰分析や因子分析を行うことが多い。この方法には批判もあるが、相関係数の推定精度の観点などから、5段階以上の尺度であれば連続変数と同様に扱っても大きな問題とはならないという結果も見られる[13]。そのため、本論文では5段階以上の尺度で得られたデータは連続変数として扱う。

第二に、カウント(計数)データを扱えることである。マーケティング・リサーチにおいては、商品の購入個数やWebページへの訪問回数、インターネット広告への接触回数など、ある事象が発生した回数を記録したカウントデータを扱うことが多い。これらのデータに対しては、ポアソン回帰モデルを用いた分析などが用いられる。例えば、ある商品の販売点数を目的変数とし、その商品価格や小売店における山積み陳列実施の有無などを説明変数としたモデルによって市場反応分析を行うことなどが挙げられる[14]。また、非耐久消費財の購入に関するデータは負の二項分布を用いてモデル化することができると示されており[1]、負の二項分布モデルを拡張したディリクレモデルを用いてブランドの購入率や購入回数を分析したりする事例も見られる[17]。本論文の提案モデルにおける離散変数のデータ生成過程の性質を満たす分布には、ポアソン分布や二項分布、負の二項回帰などが含まれており、マーケティング・リサーチの分野において活用しやすいと考えられる。

3.2 提案モデルの識別可能性

本節では、前節で定義したDAGモデルの識別可能性を証明する提案モデルは、連続変数と離散変数が混在することを許容するDAGモデルであるため、その特殊形として、全てが連続変数であるモデルや全てが離散変数であるモデルを考えることも可能である。全てが連続変数である場合は、LiNGAM[7]と同様となる。つまり、全てが連続変数である場合の識別可能性は既に証明されている[7]。また、全てが離散変数である場合は、QVF-DAGモデル[5]と同様となる。つまり、全てが離散変数である場合の識別可能性も既に証明されている[5]。そこで以下では、観測変数集合に連続変数と離散変数の両方が含まれる場合についてのみ述べる。まず、証明の方針について直感的な理解を得るために、図2のようなDAGモデルを用いて2変数モデルを用いてその識別可能性を示す。ここで X は連続変数、 Y は離散変数であるとする。

$$G_1: X = \theta_X^{(1)} + e^{(1)}, \quad e^{(1)} \sim \text{Laplace}(0, b^{(1)})$$

$$Y|X \sim \text{Poisson}(\lambda^{(1)}), \quad \log(\lambda^{(1)}) = \theta_Y^{(1)} + \theta_{YX} X$$

$$G_2: X = \theta_X^{(2)} + \theta_{XY}Y + e^{(2)}, \quad e^{(2)} \sim \text{Laplace}(0, b^{(2)})$$

$$Y \sim \text{Poisson}(\lambda^{(2)})$$



図2 2変数の DAG モデル

命題 2.3 より、 G_1 においては

$$E(Y^2) > E(Y) + E(Y)^2$$

である一方で、 G_2 においては

$$E(Y^2) = E(Y) + E(Y)^2$$

が成立する。よって、連続変数と離散変数の両方が含まれる 2 変数モデルは、離散変数のモーメント比 (8) が 1 か 1 以上かを確かめることで識別可能である。

ここからは、上記の 2 変数モデルでの証明の方針と LiNGAM の識別可能性の証明 [8] を利用することによって、提案モデルが一般的な p 変数の場合においても識別可能であることを証明する。

定理 3.2 (提案モデルの識別可能性). 定義 3.1 によって定義される DAG モデルは、識別可能である。

証明. 一般性を失わずに、真の因果順序が一意であり、 $\pi = (\pi_1, \dots, \pi_p)$ であると仮定する。また、簡単のために、 $X_{1:j} = (X_{\pi_1}, X_{\pi_2}, \dots, X_{\pi_j})$ 、 $X_{1:0} = \emptyset$ と定義する。連続変数に割り当てられた変数集合を X_C 、離散変数に割り当てられた変数集合を X_D とする。加えて、モーメント関数 $f(\mu) = \beta_0\mu + (\beta_1 + 1)\mu^2$ を定義する。ここから数学的帰納法を用いて提案モデルの識別可能性を証明する。

Step(1)

(i) $X_{\pi_1} = X_j \in X_D$ の場合

命題 2.3 より、 $E[X_{\pi_1}^2] = E[f(E[X_{\pi_1}])]$ が成立する。一方で、頂点 $j \in X_D \setminus \{\pi_1\}$ では、 $E[X_j^2] > E[f(E[X_j])]$ となる。そのため、因果順序が 1 番目の要素 π_1 を特定することができる。

(ii) $X_{\pi_1} = X_j \in X_C$ の場合

(ii - a) $X_{\pi_2} = X_k \in X_D$ の場合

命題 2.3 より、 $E[X_{\pi_2}^2] = E[f(E[X_{\pi_2}|X_{\pi_1}])]$ が成立する。一方で、頂点 $k \in X_D \setminus \{\pi_2\}$ では、 $E[X_k^2] > E[f(E[X_k|X_{\pi_1}])]$ となる。そのため、 $X_{\pi_1} = X_j \in X_C$ 、 $X_{\pi_2} = X_k \in X_D$ が、 $E[X_{\pi_2}^2] = E[f(E[X_{\pi_2}|X_{\pi_1}])]$ を満たすような $X_j \in X_C$ 、 $X_k \in X_D$ を、それぞれ因果順序が 1 番目と 2 番目の要素 π_1, π_2 を特定することができる。

(ii - b) $X_{\pi_2} = X_k \in X_C$ の場合

X_C のデータ生成過程は LiNGAM[7] と同様である。そこで、Shimizu *et al.*(2011)[8] の補題 1 を用いる。 X_j を X_k に回帰したときの残差を $r_j^{(k)} = X_j - \frac{\text{cov}(X_j, X_k)}{\text{var}(X_k)} X_k$ で表す。この時、 X_k が因果順序において最初の変数に成ることができるのは、 X_k がその残差すべて

$r_j^{(k)} (j = 1, \dots, p; j \neq k)$ と独立であるときで、かつそのときに限る。そのため、因果順序が 1 番目の要素 π_1 を特定することができる。

Step(m-1)

因果順序が $(m-1)$ 番目の要素について、因果順序が先の $(m-1)$ 個の要素とその親が正しく推定されていると仮定する。

Step(m)

因果順序が m 番目の要素とその親について考える。

(i) $X_{\pi_m} = X_j \in X_D$ の場合

命題 2.3 より、 $E[X_{\pi_m}^2] = E[f(E[X_{\pi_m}|X_{1:(m-1)}])]$ が成立する。一方で、頂点 $j \in \{\{\pi_{m+1}, \dots, \pi_p\} \cap X_D\}$ では、 $E[X_j^2] > E[f(E[X_j|X_{1:(m-1)}])]$ となる。そのため、因果順序が m 番目の要素 π_m を特定することができる。

(ii) $X_{\pi_m} = X_j \in X_C$ の場合

(ii - a) $X_{\pi_{m+1}} = X_k \in X_D$ の場合

命題 2.3 より、 $E[X_{\pi_{m+1}}^2] = E[f(E[X_{\pi_{m+1}}|X_{\pi_{1:m}}])]$ が成立する。一方で、頂点 $k \in \{\{\pi_{m+2}, \dots, \pi_p\} \cap X_D\}$ では、 $E[X_k^2] > E[f(E[X_k|X_{\pi_{1:m}}])]$ となる。そのため、 $X_{\pi_m} = X_j \in X_C, X_{\pi_{m+1}} = X_k \in X_D$ が、 $E[X_{\pi_{m+1}}^2] > E[f(E[X_{\pi_{m+1}}|X_{\pi_{1:m}}])]$ を満たすような $X_j \in X_C, X_k \in X_D$ を、それぞれ因果順序が m 番目と $(m+1)$ 番目の要素 π_m, π_{m+1} を特定することができる。

(ii - b) $X_{\pi_{m+1}} = X_k \in X_C$ の場合

X_C のデータ生成過程は LiNGAM[7] と同様である。Shimizu *et al.*(2011)[8] の補題 2 により、Step(1) と同様に、Shimizu *et al.*(2011)[8] の補題 1 を用いることによって、因果順序が m 番目の要素 π_m を特定することができる。

親変数に関しては $P(G)$ の因数分解(1) による以下の条件付き独立関係より導くことができる。

$$\begin{aligned} E(X_{\pi_m}^2) &= E(f(E(X_{\pi_m}|X_{1:(m-1)}))) \\ &= E(f(E(X_{\pi_m}|X_{Pa(\pi_m)}))) \end{aligned}$$

つまり、上記の関係が成立するような最小の集合を $X_{1:(m-1)}$ の中から π_m の親として選択することができる。

□

参考文献

- [1] A. S. C. Ehrenberg. The pattern of consumer purchases. *J. R. Stat. Soc. Ser. C Appl. Stat.*, 8(1):26–41, Mar. 1959.
- [2] C. Li and S. Shimizu. Combining linear Non-Gaussian acyclic model with logistic regression model for estimating causal structure from mixed continuous and discrete data. Feb. 2018.
- [3] G. Park and S. Park. High-Dimensional poisson structural equation model learning via ℓ_1 -Regularized regression. *J. Mach. Learn. Res.*, 20(95):1–41, 2019.
- [4] G. Park and G. Raskutti. Learning Large-Scale poisson DAG models based on OverDispersion scoring. In C. Cortes, N. D. Lawrence, D. D. Lee, M. Sugiyama, and R. Garnett eds., *Advances in Neural Information Processing Systems 28*, pp. 631–639. Curran Associates, Inc., 2015.
- [5] G. Park and G. Raskutti. Learning quadratic variance function (QVF) DAG models via overdispersion scoring (ODS). *J. Mach. Learn. Res.*, 18(1):8300–8342, Jan. 2017.
- [6] J. Pearl. *Causality: Models, Reasoning and Inference*. Cambridge University Press, USA, 2nd edition, 2009.
- [7] S. Shimizu, P. O. Hoyer, A. Hyvärinen, and A. Kerminen. A linear Non-Gaussian acyclic model for causal discovery. *J. Mach. Learn. Res.*, 7(Oct):2003–2030, 2006.
- [8] S. Shimizu, T. Inazumi, Y. Sogawa, A. Hyvärinen, Y. Kawahara, T. Washio, P. O. Hoyer, and K. Bollen. DirectLiNGAM: A direct method for learning a linear non-gaussian structural equation model. *J. Mach. Learn. Res.*, 12:1225–1248, 2011.
- [9] P. Spirtes, C. N. Glymour, R. Scheines, and D. Heckerman. *Causation, Prediction, and Search*. MIT Press, 2000.
- [10] H. R. Varian. Causal inference in economics and marketing. *Proc. Natl. Acad. Sci. U. S. A.*, 113(27):7310–7315, July 2016.
- [11] W. Wenjuan, F. Lu, and L. Chunchen. Mixed causal structure discovery with application to prescriptive pricing. In *Proceedings of the 27th International Joint Conference on Artificial Intelligence*, pp. 5126–5134. ijcai.org, 2018.
- [12] M. Yamayoshi, J. Tsuchida, and H. Yadohisa. An estimation of causal structure based on latent LiNGAM for mixed data. *Behaviormetrika*, 47(1):105–121, Jan. 2020.
- [13] 萩生田, 繁樹. 順序付きカテゴリカルデータへの因子分析の適用に関するいくつかの注意点. *心理学研究*, 67(1):1–8, 1996.
- [14] 佐藤忠彦. マーケティングの統計モデル. 朝倉書店, Aug. 2015.
- [15] 宮川雅巳. 統計的因果推論: 回帰分析の新しい枠組み. 朝倉書店, Mar. 2004.
- [16] 星野崇宏, 上田雅夫. マーケティング・リサーチ入門. 有斐閣, Dec. 2018.
- [17] 森岡毅, 今西聖貴. 確率思考の戦略論: USJ でも実証された数学マーケティングの力. KADOKAWA, May 2016.
- [18] 照井伸彦, ウィラワン・ドニ・ダハナ, 伴正隆. マーケティングの統計分析. 朝倉書店, Sept. 2009.
- [19] 片平秀貴. マーケティング・サイエンス. 東京大学出版会, 1987.
- [20] 音部大輔. マーケティングプロフェッショナルの視点. 日経 BP, Apr. 2019.

謝辞

ありがとうございました.