

# Rで学ぶ 傾向スコア解析入門

@yokkuns: 里 洋平

2011.09.24 第17回R勉強会@東京 (#TokyoR)

# AGENDA

- 自己紹介
- 傾向スコア解析
  - 実験出来るデータ
  - 実験出来ないデータ
  - 共変量調整
  - 傾向スコア推定
  - 傾向スコアを用いた調整
- Rによる実行
- 最後に

# AGENDA

- 自己紹介
- 傾向スコア解析
  - 実験出来るデータ
  - 実験出来ないデータ
  - 共変量調整
  - 傾向スコア推定
  - 傾向スコアを用いた調整
- Rによる実行
- 最後に

# 自己紹介

- ID : yokkuns
- 名前 : 里 洋平
- データマイニングエンジニア
- 統計解析 パターン認識  
機械学習 データマイニング  
NLP 金融工学 などを勉強中



# Tokyo.Rの主催者

Google グループ

« [Google グループのホーム](#)



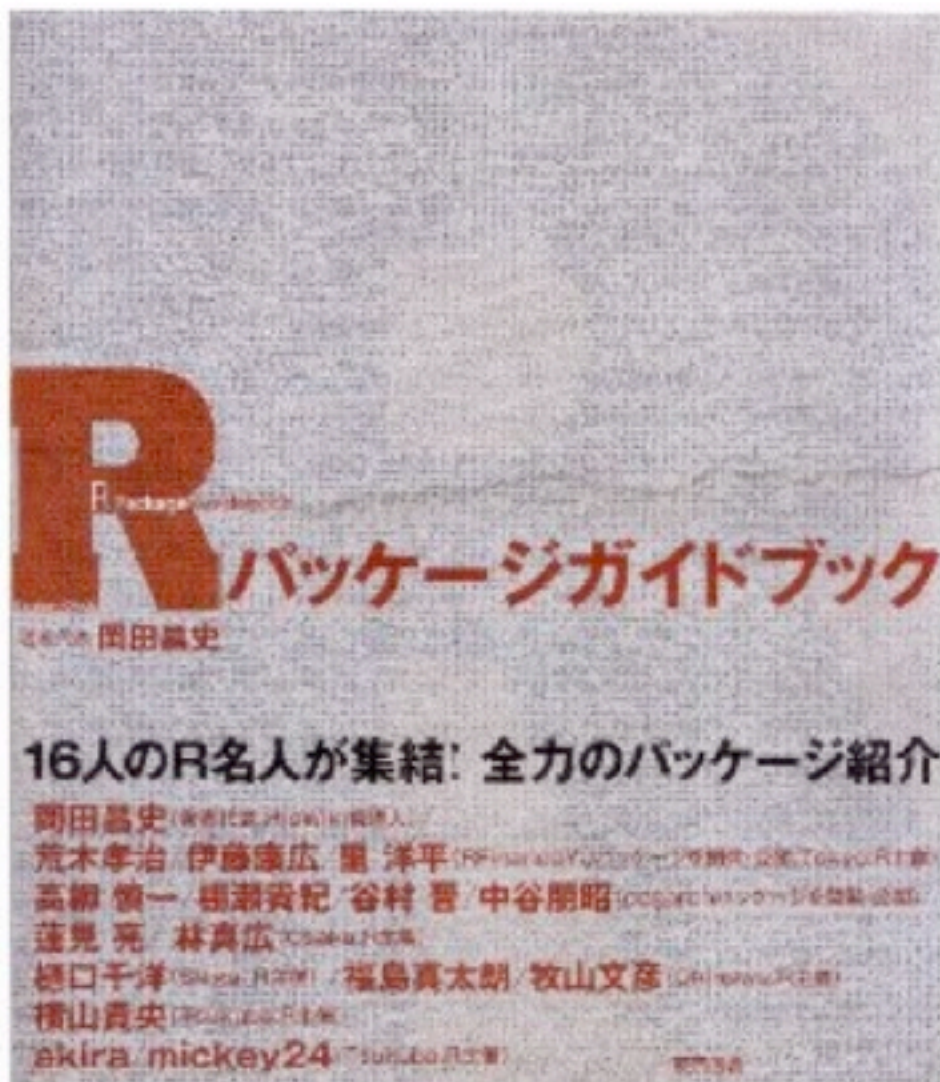
**R勉強会@東京 - Tokyo.R**

ホーム

ご参加ありがとうございます！



# Rパッケージ本執筆



## Rパッケージガイドブック [単行本]

[岡田 昌史](#) (著), [荒木 孝治](#) (その他), [伊藤 康広](#) (その他), [里 洋平](#) (その他), [高柳 慎一](#) (その他), [棚瀬 貴紀](#) (その他), [谷村 晋](#) (その他), [中谷 朋昭](#) (その他), [蓮見 亮](#) (その他), [林 真広](#) (その他), [樋口 千洋](#) (その他), [福島 真太朗](#) (その他), [牧山 文彦](#) (その他), [横山 貴央](#) (その他), [akira](#) (その他), [mickey24](#) (その他)

この商品の最初のレビューを書き込んでください。

價格： ¥ 3,990 通常配送無料 [詳細](#)

通常2~4週間以内に発送します。在庫状況について

この商品は、[Amazon.co.jp](https://www.amazon.co.jp) が販売、発送します。ギフトラッピングを利用できます。

中古品1点¥ 6,133より



# 動画レコメンド

動画レコメンド

関連オススメ動画リスト

次のリストを見る

6 / 30

SF家電 洗濯機編

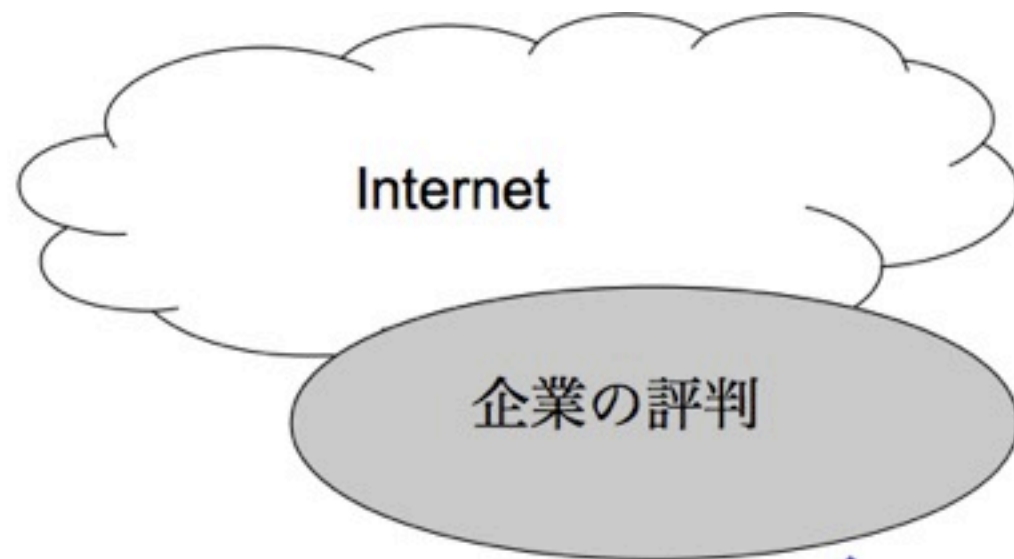
みんなの評価

評価する

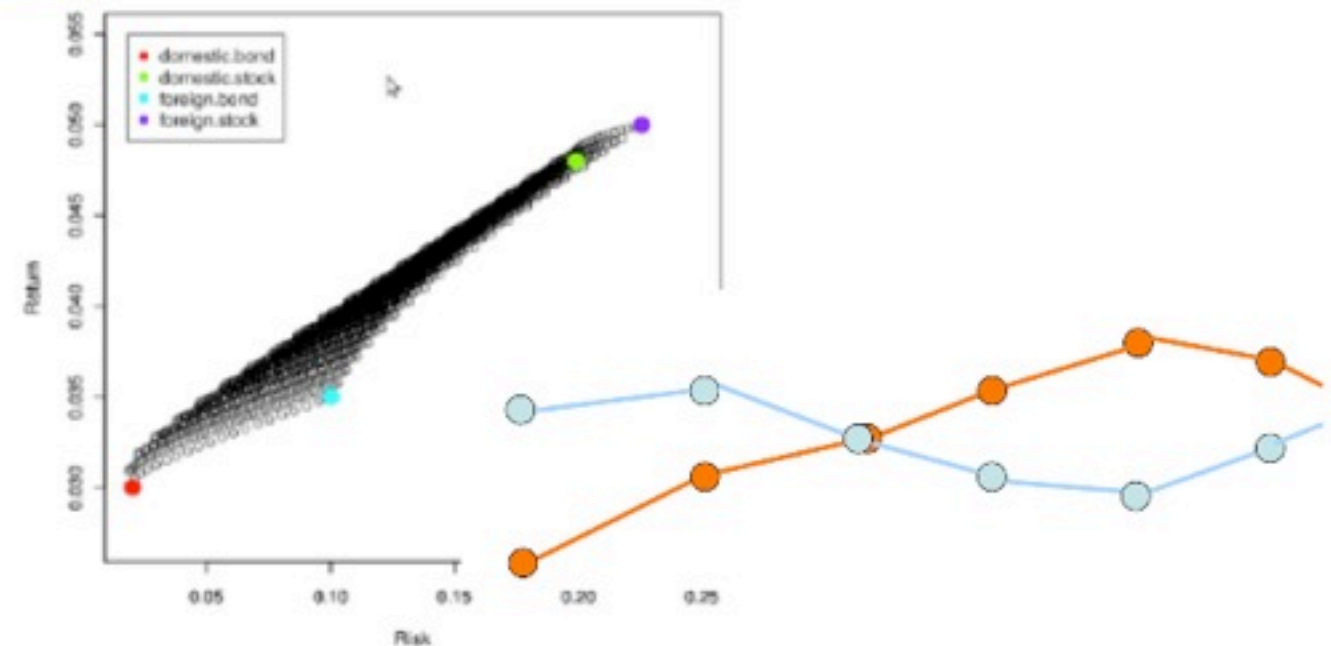
000 / 000

閲覧されてる動画に関連する おすすめ動画を表示

# テキストマイニング+金融工学



Web上にある評判情報から  
市場予測！



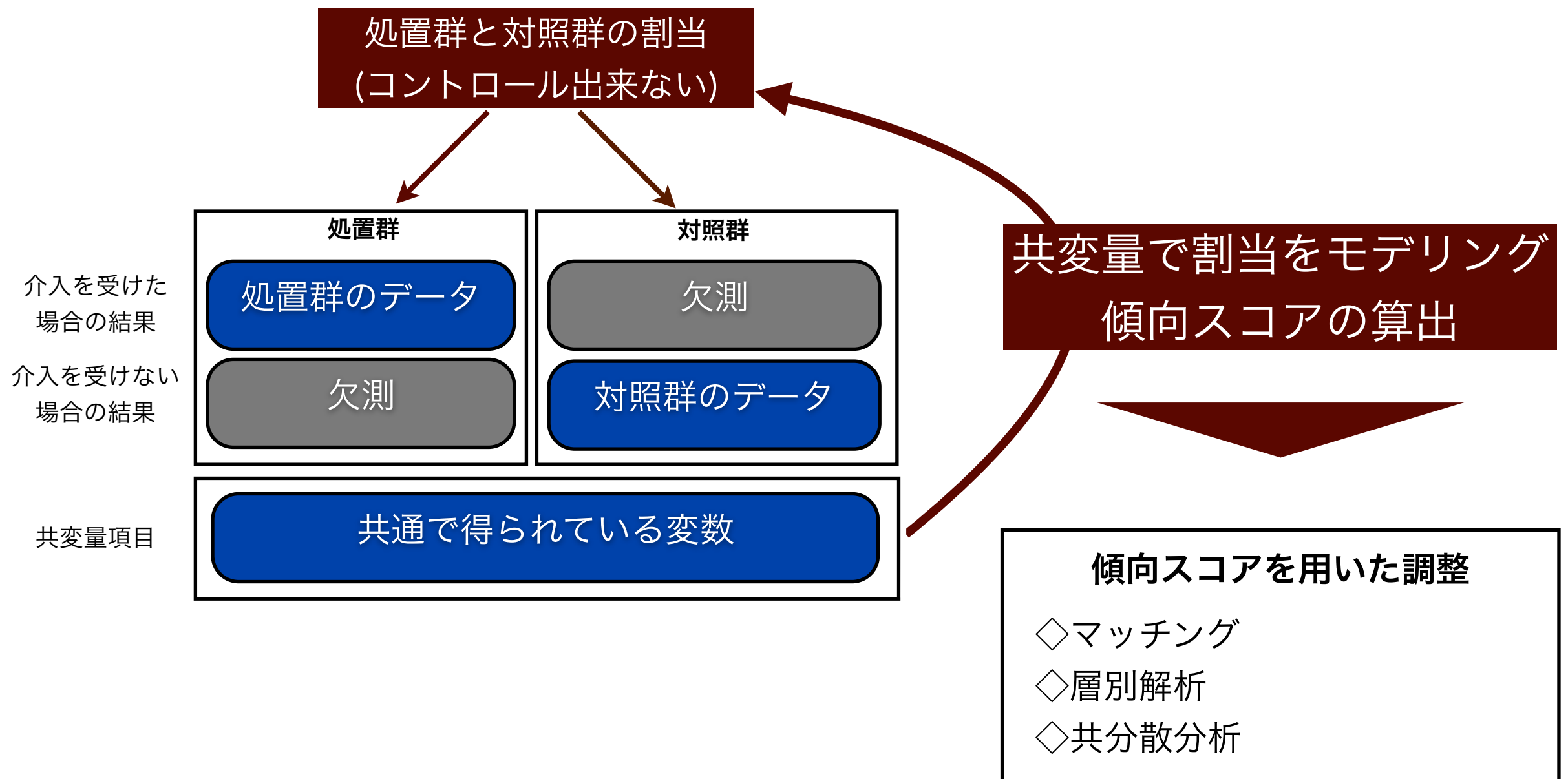


# AGENDA

- 自己紹介
- 傾向スコア解析
  - 実験出来るデータ
  - 実験出来ないデータ
  - 共変量調整
  - 傾向スコア推定
  - 傾向スコアを用いた調整
- Rによる実行
- 最後に

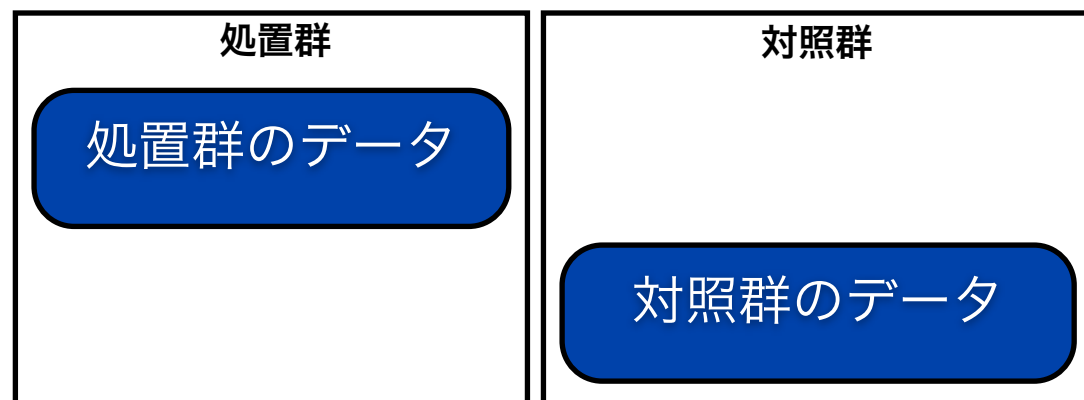
# 傾向スコア解析

実験出来ないデータの因果関係を解析する



# 実験出来るデータ

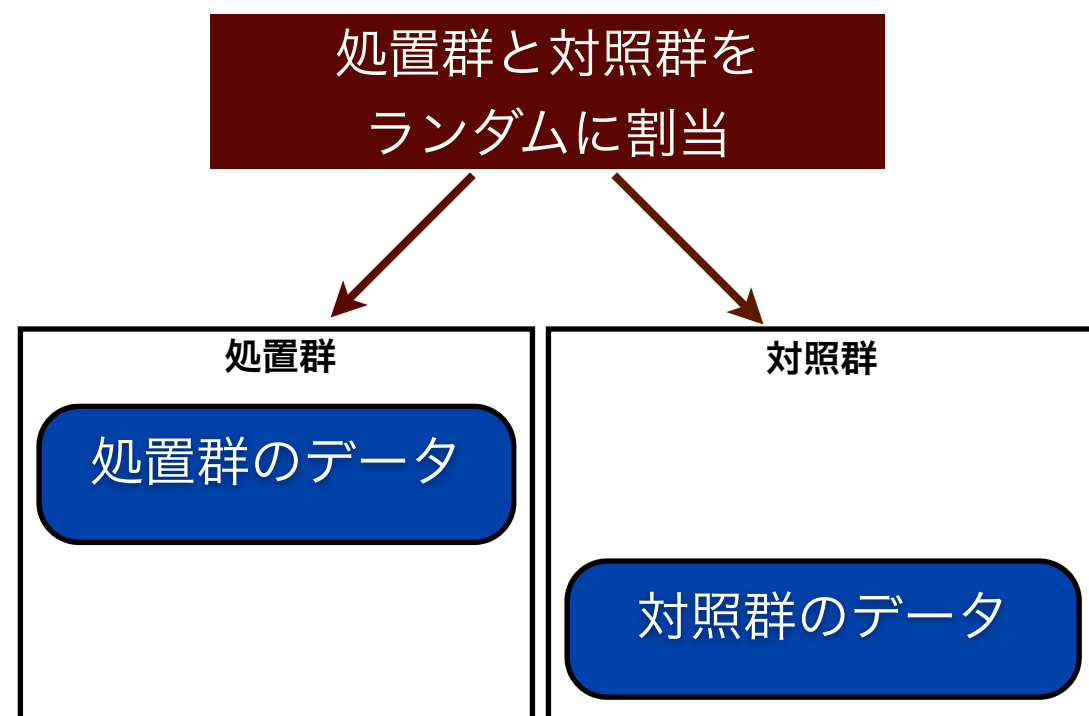
因果効果は単純な処置群と対照群の差になる



因果効果 = 処置群の平均 - 対照群の平均

# 実験出来るデータ

因果効果は単純な処置群と対照群の差になる

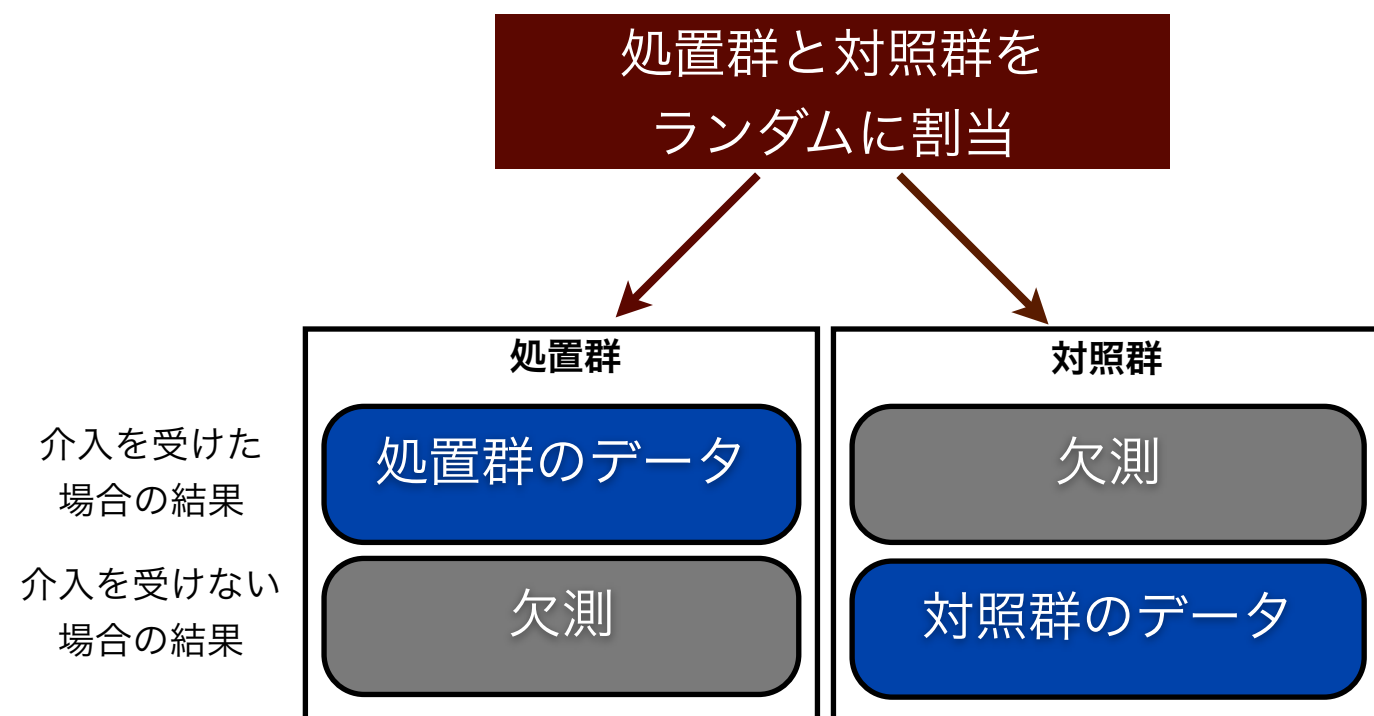


因果効果 = 処置群の平均 - 対照群の平均



# 実験出来るデータ

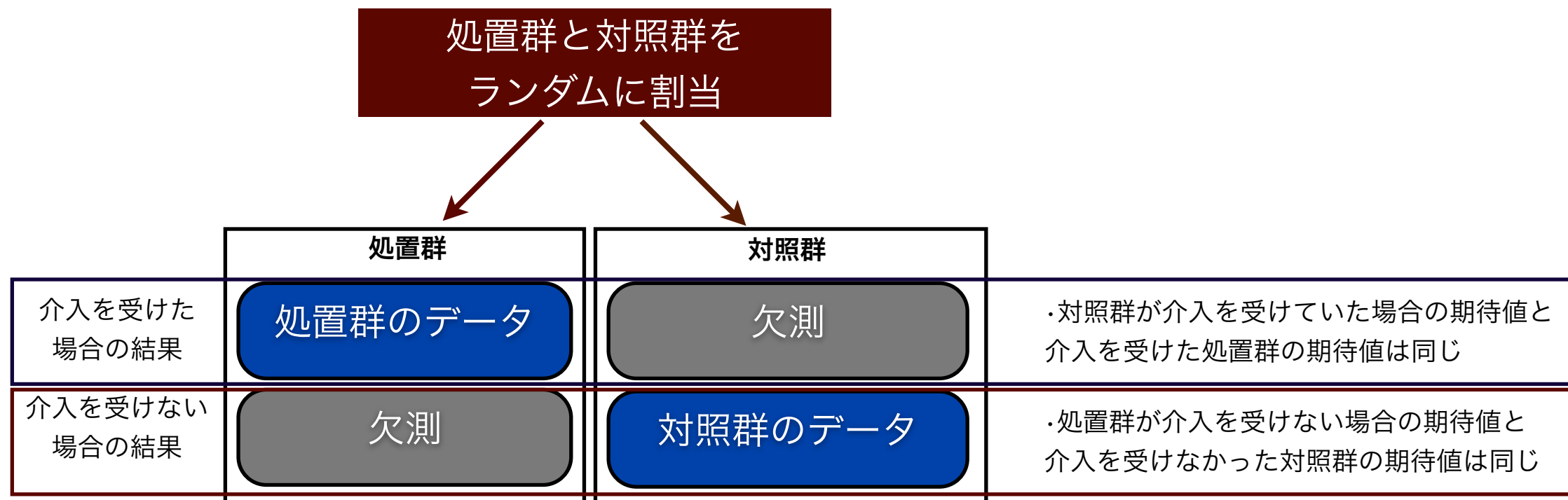
因果効果は単純な処置群と対照群の差になる



因果効果 = 処置群の平均 - 対照群の平均

# 実験出来るデータ

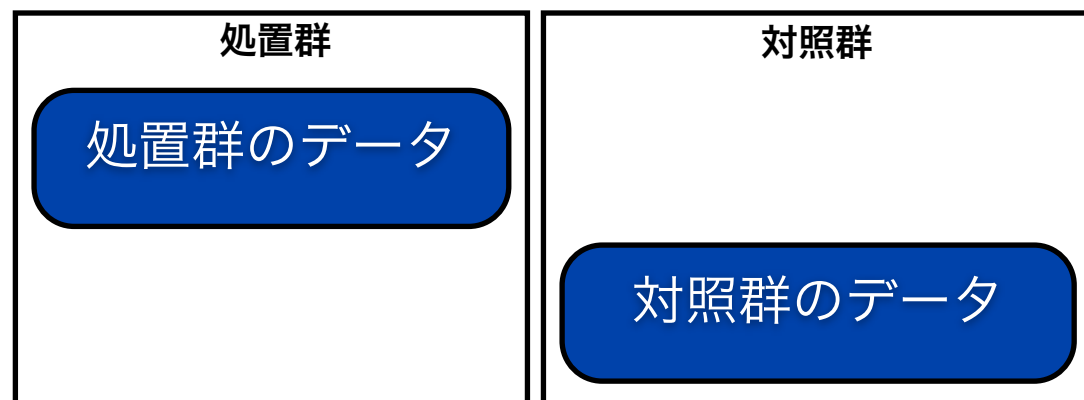
因果効果は単純な処置群と対照群の差になる



因果効果 = 処置群の平均 - 対照群の平均

# 実験出来ないデータ

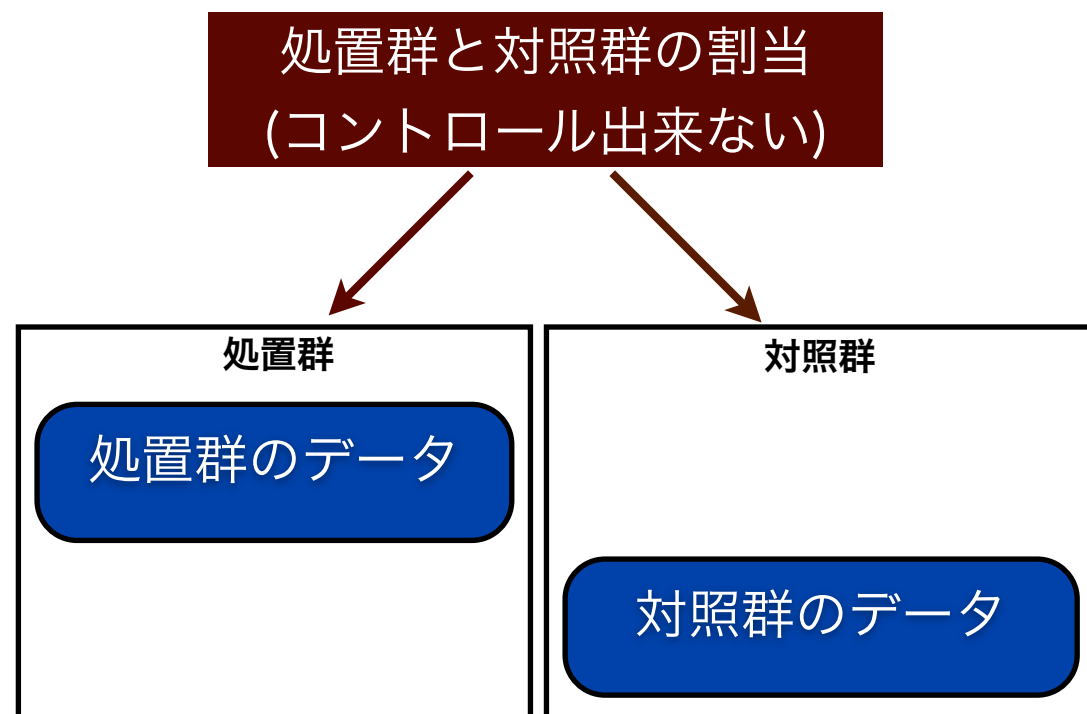
割当によって処置群と対照群に差が生じるため  
単純に比較することが出来ない



因果効果  $\neq$  処置群の平均 - 対照群の平均

# 実験出来ないデータ

割当によって処置群と対照群に差が生じるため  
単純に比較することが出来ない

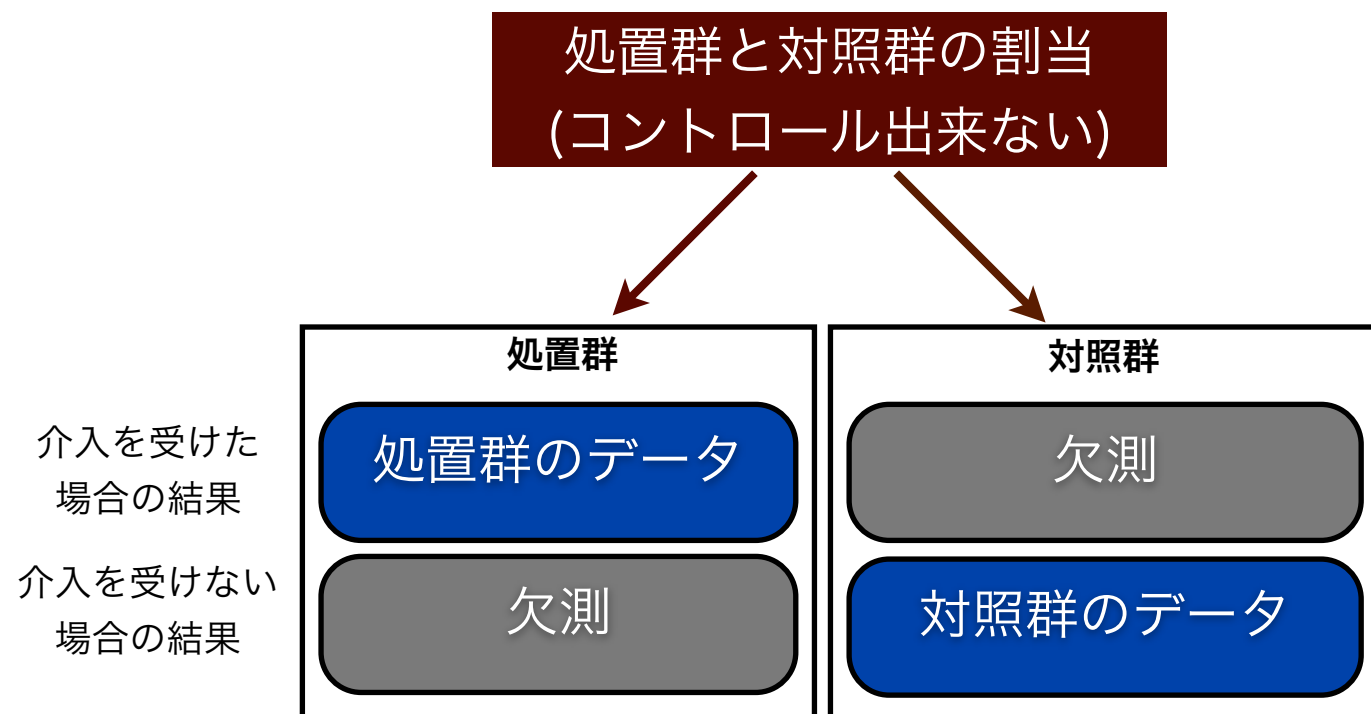


因果効果  $\neq$  処置群の平均 - 対照群の平均



# 実験出来ないデータ

割当によって処置群と対照群に差が生じるため  
単純に比較することが出来ない



因果効果  $\neq$  処置群の平均 - 対照群の平均

# 実験出来ないデータ

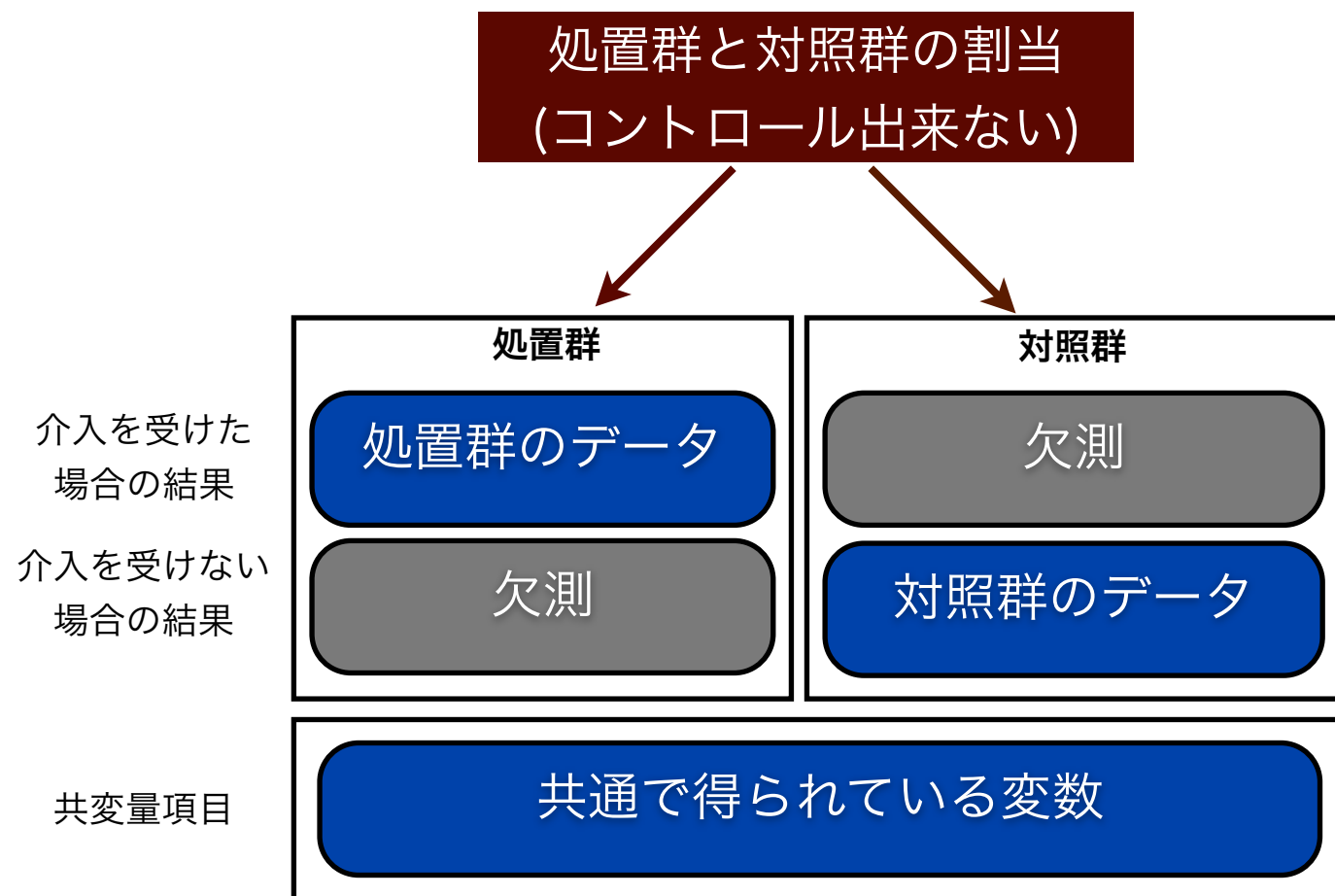
割当によって処置群と対照群に差が生じるため  
単純に比較することが出来ない

処置群と対照群の割当 (コントロール出来ない)			
	処置群	対照群	
介入を受けた 場合の結果	処置群のデータ	欠測	・対照群が介入を受けていた場合の期待値と 介入を受けた処置群の期待値が異なる
介入を受けない 場合の結果	欠測	対照群のデータ	・処置群が介入を受けない場合の期待値と 介入を受けなかった対照群の期待値が異なる

因果効果  $\neq$  処置群の平均 - 対照群の平均

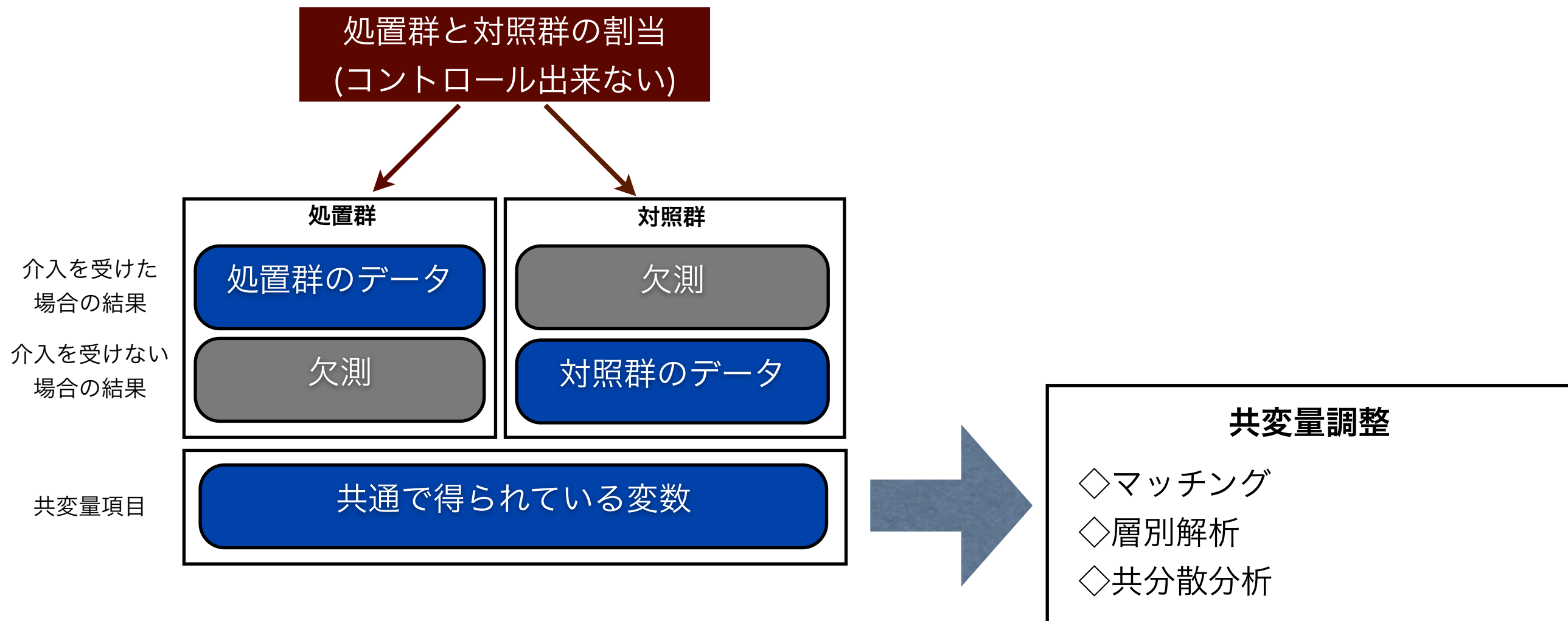
# 共変量調整

割当や結果変数に影響している共通の変数を用いて  
因果効果以外の効果を除去する



# 共変量調整

割当や結果変数に影響している共通の変数を用いて  
因果効果以外の効果を除去する





# 共変量調整：マッチング

# 共変量調整：層別解析

# 共変量調整：回帰モデル

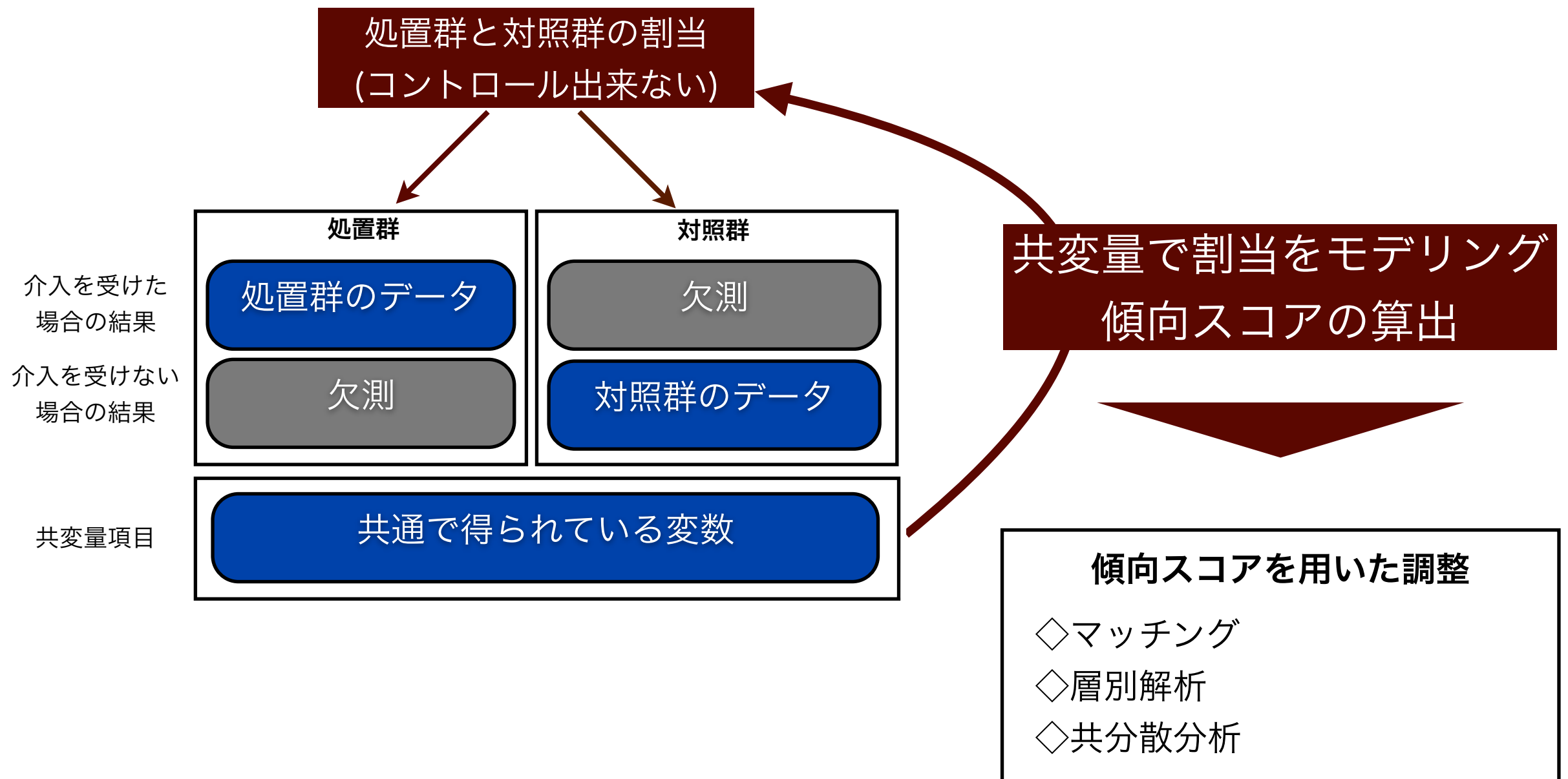
# 共変量調整の問題点

- マッチング・層別解析での問題
  - 共変量に連続変数があると完全一致のペアは作れない
  - 次元問題
  - サポート問題
- 回帰モデルでの問題点
  - 結果変数と共変量のモデリングが必要
  - 直接因果効果の推定値は得られない



# 傾向スコア解析

実験出来ないデータの因果関係を解析する



# 傾向スコアとは

# 傾向スコアの推定

# 傾向スコアを用いた調整

- マッチング
- 層別解析
- 共分散分析

# AGENDA

- 自己紹介
- 傾向スコア解析
  - 実験出来るデータ
  - 実験出来ないデータ
  - 共変量調整
  - 傾向スコア推定
  - 傾向スコアを用いた調整
- **Rによる実行**
- 最後に

# Rによる実行

# Rでマッチング実行

```
1  install.packages("Matching")
2  library(Matching)
3
4  ##
5  ## Matching
6  ##
7
8  data(lalonde)
9
10 Y78 <- lalonde$re78
11 Tre <- lalonde$treat
12 logi <- glm(treat~., data=lalonde[, -9], family=binomial)
13
14 ## default
15 summary(Match(Y=Y78, Tr=Tre, X=logi$fitted))
16
17 ##
18 summary(Match(Y=Y78, Tr=Tre, X=logi$fitted, M=2))
19
20 ## caliper matching
21 summary(Match(Y=Y78, Tr=Tre, X=logi$fitted, caliper=T))
22
```



# Rでカーネルマッチング実行

```
23  ##
24  ## kernel matching
25  ##
26
27  kmy <- lalonde$re74
28  ivecl <- lalonde$treat
29  estp <- logi$fitted
30  km <- cbind(kmy,estp, ivecl)
31  km1 <- subset(km, ivecl==1)
32  km2 <- subset(km, ivecl==0)
33  km1x <- km1[,2]
34  km1y <- km1[,1]
35  km2x <- km2[,2]
36  km2y <- km2[,1]
37  bw1 <- 1.06*(nrow(km1))(-0.2) * sd(km1x)
38  bw2 <- 1.06*(nrow(km2))(-0.2) * sd(km2x)
39  esty1 <- ksmooth(x=km1x,y=km1y,kernel="normal",
40                  bandwidth=bw1,x.points=km2x)
41  esty0 <- ksmooth(x=km2x,y=km2y,kernel="normal",
42                  bandwidth=bw2,x.points=km1x)
43
44  head(esty1$y)
45
46  head(esty0$y)
47
```

# AGENDA

- 自己紹介
- 傾向スコア解析
  - 実験出来るデータ
  - 実験出来ないデータ
  - 共変量調整
  - 傾向スコア推定
  - 傾向スコアを用いた調整
- Rによる実行
- **最後に**

次回以降の  
発表者・LTを募集しています！

ご清聴ありがとうございました

# AGENDA

- 自己紹介
- 傾向スコア解析
  - 実験出来るデータ
  - 実験出来ないデータ
  - 共変量調整
  - 傾向スコア推定
  - 傾向スコアを用いた調整
- Rによる実行
- 最後に

# 付録

# 参考文献