

計量経済学応用

8. 回帰分析 (4)

矢内 勇生

2018年5月10日

高知工科大学 経済・マネジメント学群

今日の目標

- 回帰分析を用いた統計的推定法を理解する
- 分析結果の提示法を理解する

回帰分析による推定

- データから作った散布図への直線（平面）の当てはめは、
標本データの要約
- 興味があるのは母集団の特徴
- どうやって推定する？

単回帰モデル

- 単回帰モデル

$$Y_i = \alpha + \beta x_i + \epsilon_i$$

- α 、 β : 母数 (推定の対象)
- ϵ : 誤差 (error) 。説明変数以外で結果変数に影響を与えるもの。平均すると0

最小二乗法による母数の推定

単回帰の場合

- 最小二乗法によって求めた回帰係数 a , b は、 α , β の点推定値である
- 最小二乗推定量は以下の望ましい性質をもつ
 - ▶ 不偏性： $E(a) = \alpha$, $E(b) = \beta$
 - ▶ 一致性：標本サイズを無限大にすると、推定値は母数に一致する

重回帰モデル

- 重回帰モデル

$$Y_i = \beta_0 + \beta_1 x_{i1} + \beta_2 x_{i2} + \cdots + \beta_k x_{ik} + \epsilon_i$$

- β_m : 母数（推定の対象）、 $m=0,1,2,\dots,k$
- ϵ : 誤差

最小二乗法による母数の推定

重回帰の場合

- 最小二乗法によって求めた回帰係数 b_0, b_1, \dots, b_k は、 $\beta_0, \beta_1, \dots, \beta_k$ の推定値である
 - ▶ 不偏性： $E(b_j) = \beta_j$ ($j = 1, 2, \dots, k$)
 - ▶ 一貫性

信頼区間

- 回帰分析による点推定値は、1つの標本（データ）から得られたもの
- ➡ 母数に一致するとは限らない（実際の標本サイズは有限なので）
- 統計量はばらつく（前回、シミュレーションで確認した）
 - 標準誤差：統計量のばらつき
- ➡ 信頼区間を求める！

信頼区間の意味 (1)

- 95%信頼区間とは何か？
 - ▶ よくある**誤解**：「得られた信頼区間に、真の値が入っている確率が95%」
 - ▶ 「真の値」があるなら、「得られた信頼区間に、真の値が入っている確率」は、
 - 100%（実際に入っている）
 - または
 - 0%（入っていない）

しかあり得ない

信頼区間の意味 (2)

- では、95%信頼区間とは何なのか？
 1. データを生成する（新たに観測する）
 2. データを分析する
 3. 95%信頼区間を求める
- 95%信頼区間：上の1～3までを何度も何度も繰り返し行くと、そのうち95%くらいは「真の値を含む信頼区間」が得られるだろう

信頼区間の信頼度 (1)

- 信頼区間の長さ

- ▶ 信頼度が高いほど区間が長くなる
- ▶ 信頼度が低いほど区間が短くなる

- なぜ？

- ▶ 区間を長くすれば、取りこぼしの確率が小さくなる
- ▶ 区間を短くすれば、取りこぼしの確率は大きくなる

信頼区間の信頼度 (2)

- では、信頼区間は長い方がいいのか？
 - ▶ No!
 - ▶ 同じ信頼度で、より信頼区間が短いほうが推定の不確実性が小さい
 - ▶ 信頼区間の長さ：標準誤差に依存
 - － 標準誤差が大きい：信頼区間が長い
 - － 標準誤差が小さい：信頼区間が短い

Rで回帰分析

- `lm()` 関数を使う
 - ▶ 例、`myd` という名前のデータセットに含まれる変を使い、`y`を `x1` と`x2` に回帰する

```
fit <- lm(y ~ x1 + x2, data = myd)
```

summary() で結果を確認する

- lm() で推定した後、summary() で結果を確認する
- 例 : summary(fit)
 - ▶ Estimate: パラメタの点推定値
 - ▶ Std. Error : 標準誤差 (推定の不確実性)
 - ▶ t value: t 検定で使う検定統計量
 - ▶ Pr(>|t|) : p 値

arm::display() で結果を確認する

- arm パッケージの display() 関数でも結果を確認できる
- detail = TRUE を指定すると、summary() と同じ統計量が得られる
- 例 : arm::display(fit, detail = TRUE)
 - ▶ coef.est: パラメタの点推定値
 - ▶ coef.se: 標準誤差
 - ▶ t value: t 検定の検定統計量
 - ▶ $\Pr(>|t|)$: p 値

Rで信頼区間を求める

- `lm()` を実行した後、`confint()` 関数を使うと、係数の信頼区間を求めることができる。

▶ 例

- 95%信頼区間：`confint(fit)`
 - 50%信頼区間：`confint(fit, level = 0.5)`
 - 67%信頼区間：`confint(fit, level = 0.67)`
- ▶ 上のコマンドを実行すると、信頼区間の下限値と上限値が表示される

信頼区間の図示

- ggplot2 を使えば、以下のものが図示できる
 - ▶ 回帰直線 + 95%信頼区間
 - `geom_smooth(method = "lm")`
 - ▶ 回帰直線 + 89%信頼区間
 - `geom_smooth(method = "lm" , level = 0.89)`
 - ▶ 回帰直線のみ
 - `geom_smooth(method = "lm" , se = FALSE)`

回帰分析における仮説検定

- 回帰分析では、説明変数が結果変数に影響を与えているかどうかに関心がある
 - 帰無仮説：説明変数の影響はない（影響が0である）
 - 対立仮説：説明変数の影響がある（影響が0ではない）

単回帰の場合

- 帰無仮説： $\beta = 0$
- 対立仮説： $\beta \neq 0$
- ▶ α は説明変数の影響ではないので、通常はあまり気にしない

重回帰の場合

- パタン1

- 帰無仮説： $\beta_1 = \beta_2 = \cdots = \beta_k = 0$
- 対立仮説：少なくとも1つは0でない

- パタン2（複合仮説）

- 帰無仮説： $\beta_1 = 0, \beta_2 = 0, \cdots, \beta_k = 0$
- 対立仮説： $\beta_1 \neq 0, \beta_2 \neq 0, \cdots, \beta_k \neq 0$

パターン1の仮説検定

- p 値が設定した有意水準より小さいとき
 - 帰無仮説を棄却する
 - 係数は「統計的に有意 (statistically significant)」である（「優位」ではない！）
- p 値が設定した有意水準以上のとき
 - 帰無仮説をとりあえず受容：対立仮説が正しいとはいえないという弱い結論

統計的に有意とは？

- 効果が「ゼロではない」と信じるに足る証拠がある
 - ▶ それだけ！
- 「ゼロではない」 ≠ 重要
- 研究においては、「重要である」ことを示すことが求められる
 - ▶ 実質的重要性 (substantive significance) を示すことが必要（浅野・矢内 2013: pp. 134-137 を参照）
- 係数の値そのもの（効果量, effect size）を議論することが絶対に必要！！！！

効果がないことを証明できる？

- 効果がないことを証明したいとき、 $\beta=0$ という帰無仮説が受容されることは証拠として使える？

➡使えない！

- 統計的仮説検定の方法では、効果がない証拠を見つけることは不可能（ベイズ法でROPEというものを設定する必要）

回帰分析の結果の提示

- 図、表または式の形で表す
- 係数だけでなく、不確定性（標準誤差, t値 [検定統計量], またはp値） も一緒に示すことが必要
 - ▶ どの不確定性指標を使っているかはっきり示すこと！
- 点推定値と信頼区間を図示するのがベスト！
- 観測数（標本サイズ）と決定係数（重回帰の場合は自由度調整済み決定係数）も示す
- Rのsummary() または display() の結果をそのままコピペしない！
 - ▶ 読みやすい、綺麗な表が必要

結果提示の例：式の場合

$$\text{身長} = 107.2 + 0.19 \times \text{父の身長} + 0.21 \times \text{母の身長}$$

(4.93) (0.02) (0.02)

注：括弧内は標準誤差

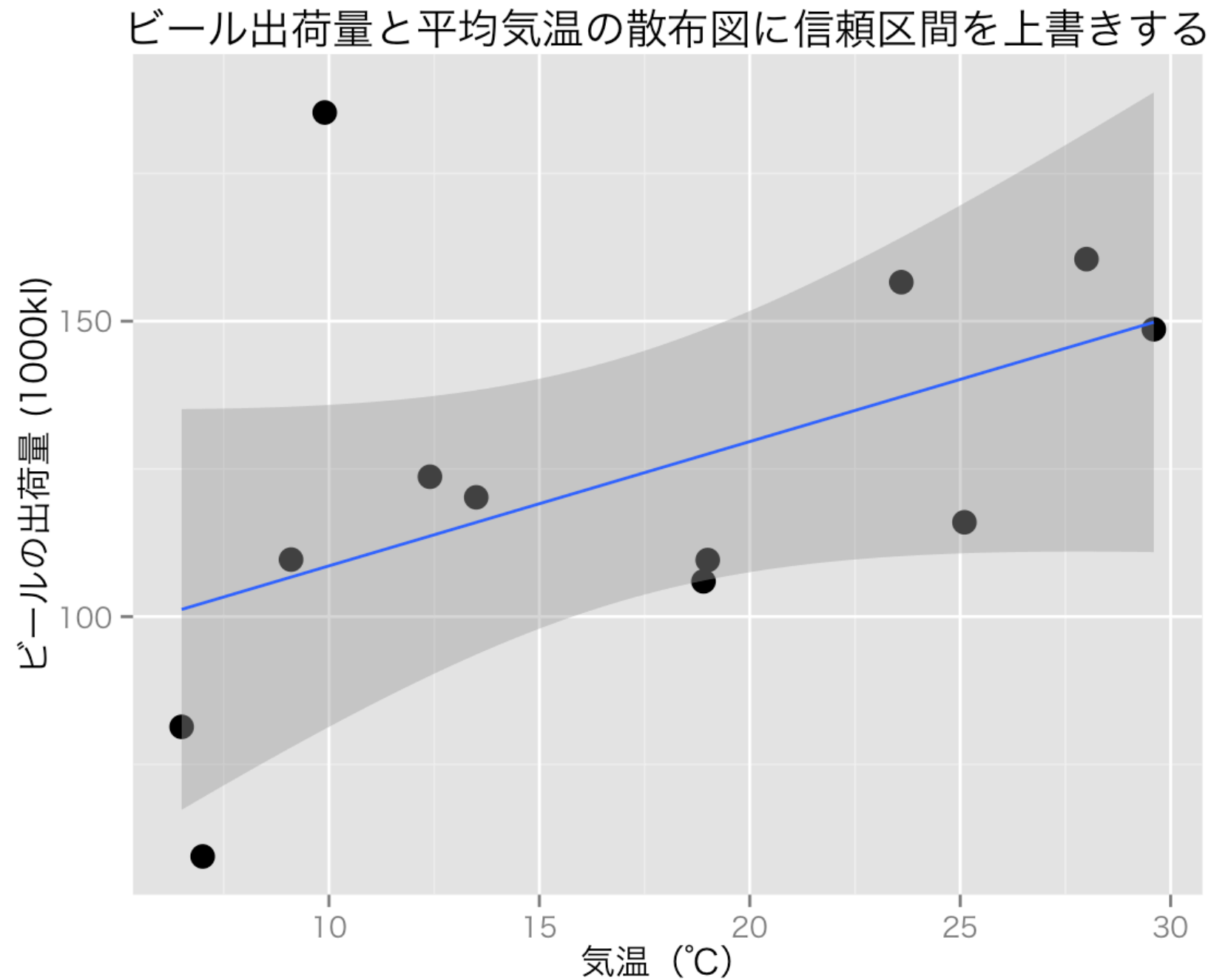
- ・ 括弧内にp値を書けば、ある有意水準の下で棄却されるか受容されるかが一目でわかる
- ・ seが書かれている場合の目安：有意水準5%なら、係数÷SE の値が2以上なら帰無仮説を棄却
- ・ t値（検定統計量）を書いても理論的には問題ないが、臨界値を求めないと棄却か受容か判断できないので、あまり好まれない

結果提示の例：表の場合

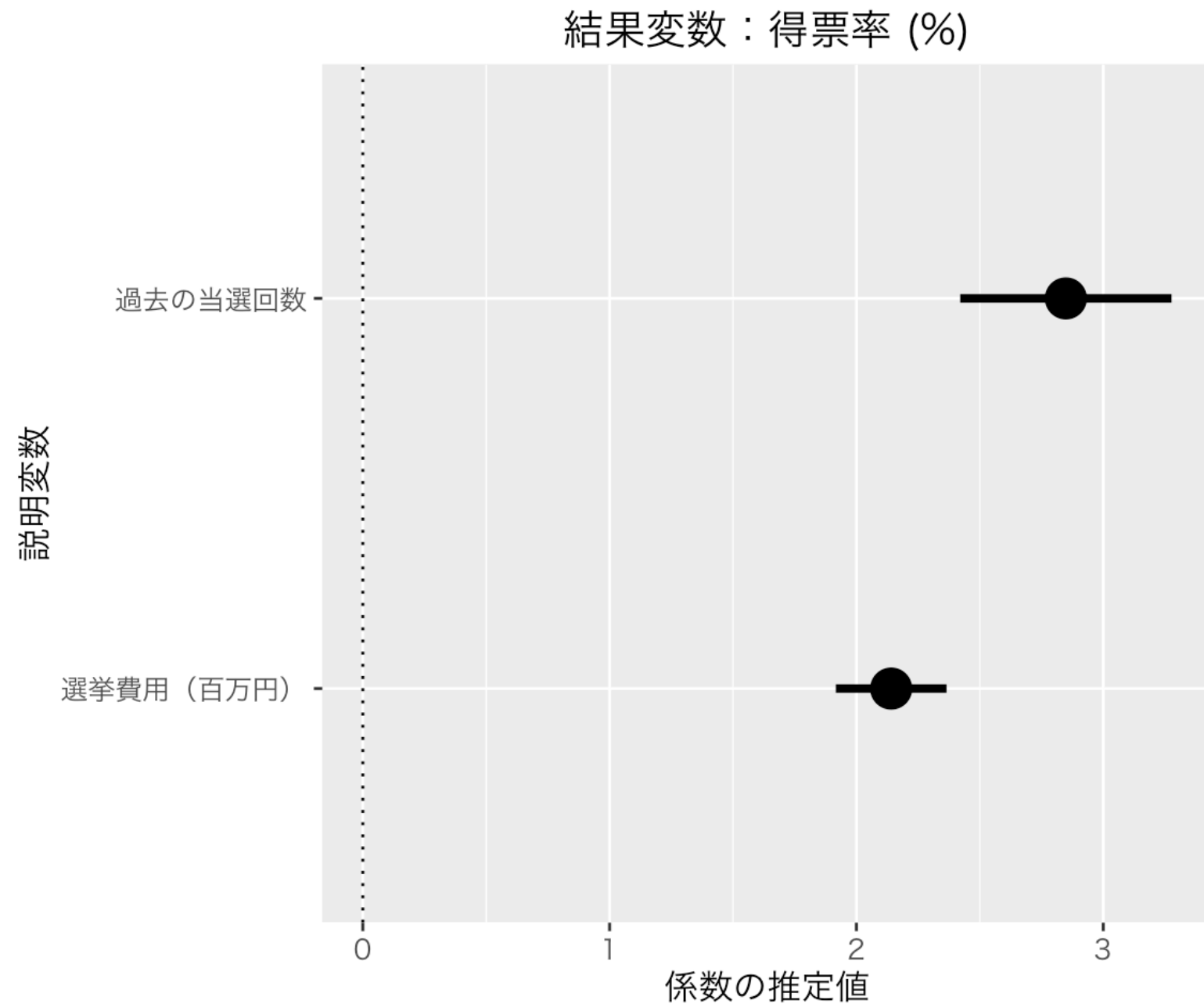
表1. 回帰分析の結果（結果変数は自民党の得票率）

説明変数	推定値	標準誤差	95%信頼区間		p値
			下限	上限	
説明変数1	-0.10	0.37	-0.85	0.65	0.79
説明変数2	0.07	0.46	-0.86	0.99	0.89
説明変数3	1.68	0.27	1.14	2.22	0.00
説明変数4	0.77	0.05	0.67	0.87	0.00
説明変数5	0.25	0.35	-0.45	0.95	0.47
説明変数6	42.15	0.33	41.48	42.83	0.00
観測数	47				
自由度調整済み決定係数	0.88				
F 統計量	66.11				
自由度 (5, 41)					

結果提示の例：単回帰の図示



結果提示の例：重回帰の図示



注：点は係数の推定値、線分は95%信頼区間を表す。