



|                        |   |
|------------------------|---|
| Title                  | 講義のーと： データ解析のための統計モデリング   |
| Author(s)              | 久保, 拓弥  |
| Issue Date             | 2008  |
| Doc URL                | <a href="http://hdl.handle.net/2115/49477">http://hdl.handle.net/2115/49477</a>   |
| Type                   | learningobject  |
| Note                   | この講義資料は、著者のホームページ <a href="http://hosho.ees.hokudai.ac.jp/~kubo/ce/EesLecture2008.html">http://hosho.ees.hokudai.ac.jp/~kubo/ce/EesLecture2008.html</a> からダウンロードできます。 |
| Note(URL)              | <a href="http://hosho.ees.hokudai.ac.jp/~kubo/ce/EesLecture2008.html">http://hosho.ees.hokudai.ac.jp/~kubo/ce/EesLecture2008.html</a>                                 |
| Additional Information | There are other files related to this item in HUSCAP. Check the above URL.  |
| File Information       | kubostat2008c.pdf (第3回)   |



[Instructions for use](#)

データ解析のための統計モデリング (2008 年 10-11 月)

全 5 (+2) 回中の第 3 回 (2008-11-06)

# 一般化線形モデル (GLM) 1

久保拓弥 kubo@ees.hokudai.ac.jp

<http://hosho.ees.hokudai.ac.jp/~kubo/ce/EesLecture2008.html>

この講義のーとが「データ解析のための統計モデリング入門」として出版されました!

<http://hosho.ees.hokudai.ac.jp/~kubo/ce/IwanamiBook.html>

まちがいを修正し、詳しい解説・新しい内容をたくさん追加したものです

## 今日のもくじ

|   |    |
|---|----|
| 1. 一般化線形モデル (GLM) って何なの?                            | 1  |
| 2. GLM の部品: 確率分布, link 関数, 線形予測子                    | 4  |
| 3. GLM の例題: 架空植物のデータ解析                              | 5  |
| 4. 統計モデリング: <code>glm(..., family = poisson)</code> | 9  |
| 5. 因子型の説明変数の場合                                      | 14 |
| 6. 説明変数が数量型 + 因子型のモデル                               | 16 |
| 7. Deviance って何なの?                                  | 17 |
| 8. 「よい」モデルを選ぶモデル選択                                  | 21 |
| 9. 今日のまとめ   | 22 |

「生態学の統計モデリング」第 3 回目です。今回は統計モデルの基本部品である確率分布、とくにポアソン分布について説明しました。そしてポアソン分布のパラメーターは最尤推定法によって推定できる、といったことを説明しました。前回の例は簡単だったので、ポアソン分布の平均をあらわす  $\lambda$  は簡単に推定でき、さらに「最尤推定値は標本平均値に等しい」といったことが簡単に示しました。

今日はもう少し複雑な統計モデル、たとえば確率分布の平均が  $\lambda$  だとすると、

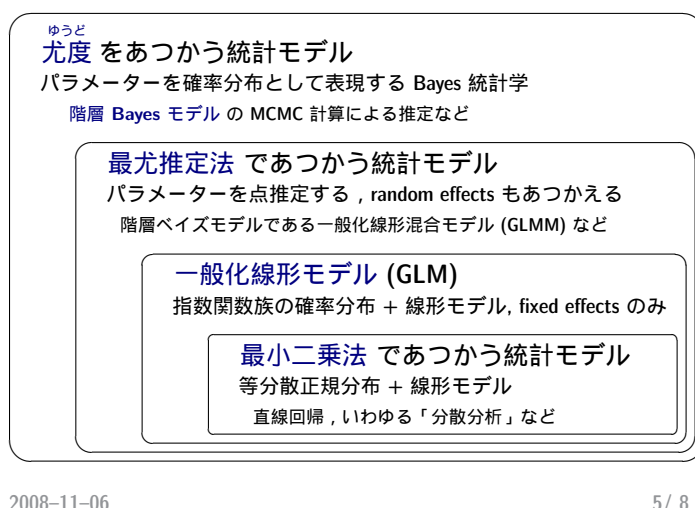
$$\lambda = (\beta_1 + \beta_2 \times (\text{要因 1}) + \beta_3 \times (\text{要因 2}) + \dots) \text{の関数}$$

といったモデルを考えて、そのパラメーター  $\{\beta_j\} = \{\beta_1, \beta_2, \dots\}$  を推定す

る, といった問題をあつかいます. これは一般化線形モデルの推定問題として解決できる場合があります.

## 1. 一般化線形モデル (GLM) って何なの?

具体的な統計モデリングに入る前に, 一般化線形モデルをめぐる歴史的な経緯みたいなものを少し見てみましょう. 以前にも説明したように, データ解析に使われる統計モデルの範囲は図1の内側 → 外側にむけて拡大してきました.<sup>1</sup>



1. 統計モデルの場合, 考えつかれた時期からずいぶんと時間が経過してからふつーのデータ解析者たちに使われるようになったりします. 新しい統計モデル普及の重要な理由のひとつは個人用コンピュータがここ 20 年ぐらいでずいぶんと高速化した, ということがあると思います.

図 1: 統計モデルの「地図」

まず一番内側「等分散正規分布の統計モデルしか考えないからパラメーター推定は何でも最小二乗法でよい」の世界で, (まぎらわしいのですが) 一般線形モデル (general linear model) なるものが提唱されました. これはひらたく言ってしまえば「統計学といえは何でも正規分布の皆さん, あなたたちはデータの種類によって ANOVA とか重回帰とか ANCOVA とか使いわけてるみたいですけど, それって統計モデルの見地からすれば

- ばらつきをあらわす確率分布が正規分布
- 確率分布の平均 = 線形予測子<sup>2</sup>
- 確率分布の分散は一定

2. あとで説明します.

という同じ統計モデルを何だか別ものあつかいしちゃってるのでは? これらは general linear model として統一的に理解して, アタマの中をすっきり整

理しましょうよ」といった趣旨なのだろうと思います。しかし一般線形モデルなる用語はあまり使われていません。というのも、一般線形モデルもその中に含んでしまう、より強力な統計モデルが普及していったからでしょう。

ここで一般線形モデルの例として、直線回帰（直線のあてはめ）の概念を図2に示してみます。<sup>3</sup>

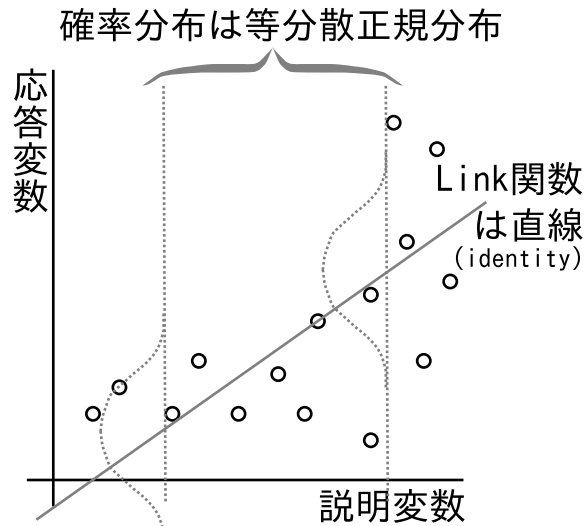


図2: 古典的な直線あてはめ (一般線形モデル)

この講義では、「データを図にして、ばらつきをよく見て、統計モデルの部品である確率分布を選んで……」といった統計モデリングのお作法をおススメしております。ということで、それが実現できそうな統計モデリングとして、とりあえずはじめに一般化線形モデル(図3)から始めましょう、というのが今日のハナシです。

一般化線形モデル (generalized linear model; GLM) は「正規分布だけ」の一般線形モデルよりさらに強化<sup>4</sup>された統計モデルです:

- 確率分布は正規分布だけでなく、ポアソン分布・二項分布・ガンマ分布などが選択できる<sup>5</sup>
- 確率分布の平均は線形予測子だけでなく link 関数にも依存する
- 確率分布の分散は使っている確率分布にあわせて変化する (例: ポアソン分布なら分散は平均とともに増大)

この GLM の中で今回はポアソン分布をつかった統計モデルの例、次回は二項分布をつかった統計モデルの例を説明します。どちらもカウントデータ<sup>6</sup>の統計モデリングに使います。

3. この図2で「直線回帰でダメな場合もけっこうあるのでは?」と言いたかったポイントとしては……たとえば応答変数が 0, 1, 2, 3, … と数えられるカウントデータだったとしましょう。その場合、(1) 期待値(直線)がマイナスになるってヘンじゃない? (2) 図でみると「ばらつき一定」ではなさそう? といったところでしょう。で、やっぱり「分布をよく見て」確率分布を選んで統計モデリングしましょう、というハナシにつなげたいわけです。

4. いわば現実のデータ解析にあわせた、といいますが

5. これらは指数関数族の確率分布です。

6. これは「何でも正規分布」世界ではうまくあつかえません。

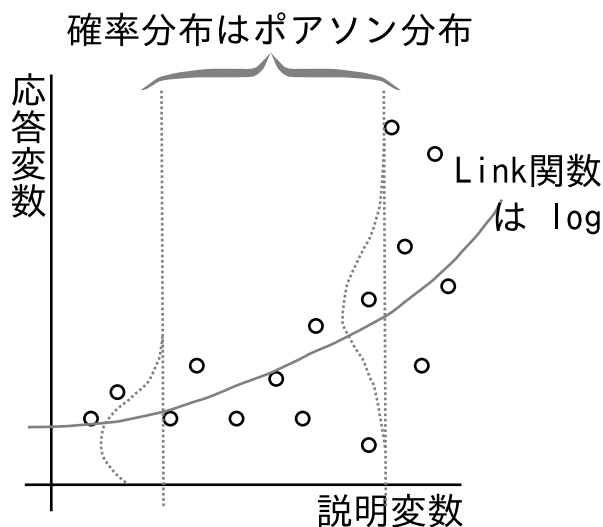


図 3: 一般化線形モデルによるあてはめの例

一般化線形モデルという名前は、こういうモデリングを普及したかったヒトたちが「ポアソン分布や二項分布をつかった統計モデリングも、皆さんよくご存知の線形モデルをちょっと拡張したものにすぎませんよ」といった意図もこめてつけたのかもしれない。いっぽうで(とくに正規分布に固執してるわけではない)統計学的手法ユーザーからすると、(線形の)ポアソン回帰<sup>7</sup>やlogistic回帰<sup>8</sup>や正規分布の統計モデルをタバねたものを「一般化線形モデル」と呼んでいる、という理解でもよいかと思えます。<sup>9</sup>

7. ポアソン分布をつかった統計モデルによるパラメーター推定

8. 二項分布 + logistic モデルをつかった統計モデルによるパラメーター推定

9. なぜ「線形」モデルなのか? 線形にしとくとわかりやすくて推定計算もやりやすい、といったご利益があります。

## 2. GLM の部品: 確率分布, link 関数, 線形予測子

GLM を構成する部品は確率分布 (probabilistic distribution) ・link 関数 (link function) ・線形予測子 (linear predictor) ・です。GLM で使える、正確に言えば R の `glm()` 関数で使える確率分布は前回の講義のーとでも示しましたが、下のとおりです。

|      | 確率分布    | 乱数生成                   | パラメーター推定                            |
|------|---------|------------------------|-------------------------------------|
| (離散) | ベルヌーイ分布 | <code>rbinom()</code>  | <code>glm(family = binomial)</code> |
|      | 二項分布    | <code>rbinom()</code>  | <code>glm(family = binomial)</code> |
|      | ポアソン分布  | <code>rpois()</code>   | <code>glm(family = poisson)</code>  |
|      | 負の二項分布  | <code>rnbinom()</code> | <code>glm.nb()</code>               |
| (連続) | ガンマ分布   | <code>rgamma()</code>  | <code>glm(family = gamma)</code>    |
|      | 正規分布    | <code>rnorm()</code>   | <code>glm(family = gaussian)</code> |

link 関数 (link function) について説明する前に、まず線形予測子について簡単に説明してみます。最小二乗法でパラメータ推定する (正規分布でばらつきを説明する) 統計モデルでは平均  $\mu$  が

$$\mu = \beta_1 + \beta_2 \times (\text{要因 1}) + \beta_3 \times (\text{要因 2}) + \dots$$

となっている必要があります、パラメータ  $\{\beta_j\}$  を最小二乗法で推定します。要因というのは、より具体的には説明変数 (explanatory variable) の値です。見ればわかるように右辺が

$$\sum_j \beta_j \times (1 \text{ もしくは説明変数の値})$$

というふうに推定したいパラメータの線形結合になっているので、この統計モデルは線形モデルと名づけられています。また

$$z = \sum_j \beta_j \times (1 \text{ もしくは説明変数の値})$$

と定義すると、 $z$  は線形予測子とよばれたりします。GLM とはモデル内のどこかにこの線形予測子をもつ統計モデルのことです。<sup>10</sup>

なお、説明変数に対して、統計モデルで「説明される」ほうは応答変数 (response variable) とよばれます。<sup>11</sup>

一般化線形モデルでは単純な  $\mu = z$  の場合<sup>12</sup> だけでなく、たとえば log link 関数を適用すると、平均を  $\log \mu = z$  と定義してもさしつかえない、つまり

$$\mu = \exp(\beta_1 + \beta_2 \times (\text{要因 1}) + \beta_3 \times (\text{要因 2}) + \dots)$$

といった統計モデルのパラメータ推定も可能になる、ということです。パラメータの推定値は、前回の講義で説明した最尤推定法 (数値的な最尤推定法) によって計算されます。

GLM では「この確率分布なら、この link 関数を使うことが多い」<sup>13</sup> という組み合わせがあります。また確率分布 (R の glm() 関数の family 指定) と平均値などがきまると、そのばらつき (分散) もきまります。<sup>14</sup>

|      | 確率分布    | glm() の family | よく使う link 関数 | 分散 ( $m$ は平均)      |
|------|---------|----------------|--------------|--------------------|
| (離散) | ベルヌーイ分布 | binomial       | logit        | $\mu(1 - \mu)$     |
|      | 二項分布    | binomial       | logit        | $\mu(1 - \mu)$ (注) |
|      | ポアソン分布  | poisson        | log          | $\mu$              |
| (連続) | ガンマ分布   | gamma          | log かな?      | $\mu^2$            |
|      | 正規分布    | gaussian       | identity     | 一定                 |

10. ただし、好きなように確率分布や link 関数を選べない、という制約はありますけど。

11. 独立変数・従属変数といういいかたはちょっとまぎらわしいので、最近では説明変数・応答変数とよばれることが多いです。

12. これは R の glm() の identity link 関数つまり「そのまま」link 関数に該当します。

13. canonical link function などと呼ばれていた。この canonical 以外の link 関数が使える場合もあります。

14. 表中の二項分布の分散の (注): 正確には、 $Np(1-p)$ 、ただし  $N$  は最大生起数、 $p$  は生起確率。

### 3. GLM の例題: 架空植物のデータ解析

さて、ここから図 4 に示されてる架空植物の種子数データの統計モデリングをととして GLM を使ったデータ解析について考えてみましょう。この節では、統計モデリングに着手する前の準備として、この例題であつかう架空データについてまず説明してみます。ここではこの架空植物の個体ごとの種

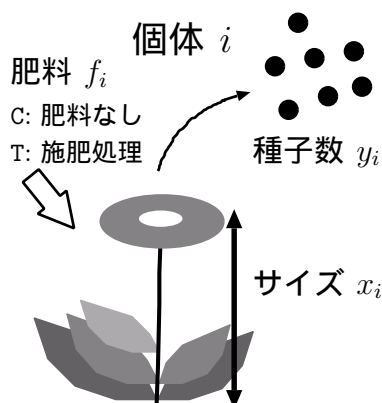


図 4: 架空植物の第  $i$  番目の個体 ( $i = 1, 2, \dots, 100$ )

子数がどのように決まるか (統計モデルでどう表現するのがよいのか) をあつかいたいとします。個体は  $i$  という記号であらわされ ( $i = 1, 2, 3, \dots, 100$ , つまり 100 個体います), その種子数は  $y_i$ ; 「サイズ」<sup>15</sup> は  $x_i$ ; また全個体のうち 50 個体 ( $i = 1, 2, \dots, 50$ ) は特に何もしてないけど (C 個体), 残り 50 個体 ( $i = 51, 52, \dots, 100$ ) には施肥処理と称して肥料をあげた (T 個体), とします。

この架空植物の観測データが何か spreadsheet ソフトウェア<sup>16</sup> に格納されていたとして、これを「別名で保存」とかで CSV (comma separated values) 形式で保存したとします。<sup>17</sup>

もしそのファイル名が data3a.csv<sup>18</sup> だとすると、R では<sup>19</sup>

```
> d <- read.csv("data3a.csv")
```

と命じるだけでファイルを読みこんで data.frame というデータ構造に格納してくれます。ここでは d という名前が付けられています。<sup>20</sup> data.frame はとりあえず「table のようにあつかえるデータ構造」と考えてください。

R 内ではどのようにデータが格納されているのでしょうか? それを確認するためには、d とだけ指示して ENTER を押すと全データ表示されます。

15. どうせ架空植物なので具体的には何も考えてなくて.....「高さ」でも「重量」でも何でもいいです。

16. たとえば、皆さんが好きで (そして私が好きではない)「彙くせる」など。

17. CSV はテキストファイルになっているので、多くのソフトウェアでも読みこむことができます。

18. これは講義 web page からダウンロードできます。

19. このデータ読みこみ操作をする前に、R メニューの「ディレクトリの変更...」または R 関数の `setwd()` を使って data3a.csv が置いてあるディレクトリに移動する必要があります。

20. 入力がラクだから、という理由のためです。





にはクラス) に属しているか調べられます。<sup>25</sup>

```
> class(d) # d そのものは data.frame であり,
[1] "data.frame"
> class(d$y) # y 列は整数だけの integer 型
[1] "integer"
> class(d$x) # x 列は実数も含むので numeric 型
[1] "numeric"
> class(d$f) # そして f 列は factor 型
[1] "factor"
```

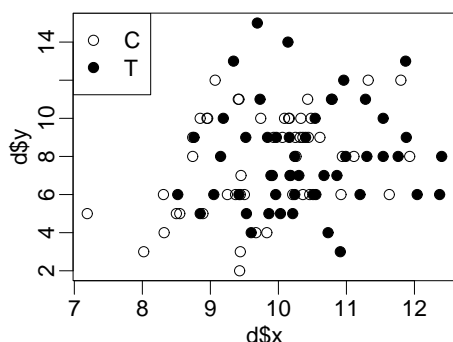
さて, R の `summary()` 関数を使ってこの `d` と名づけられた `data.frame` の概要を把握してみましょう.

```
> summary(d)
      y          x          f
Min.  : 2.00   Min.   : 7.190   C:50
1st Qu.: 6.00   1st Qu.: 9.428   T:50
Median : 8.00   Median :10.155
Mean   : 7.83   Mean    :10.089
3rd Qu.:10.00   3rd Qu.:10.685
Max.   :15.00   Max.    :12.400
```

`data.frame` の `summary` はこのように列ごとに表示されます。<sup>26</sup> どのように “summary” されてしまうか, それは列の型に依存しています.

やはりデータ全体を「見る」には `plot()` 関数なんかで図にしてみるのが一番わかりやすいですね. これは横軸に `x` 列, タテ軸に `y` 列をとった散布図 (scatter plot) です.

```
> plot(d$x, d$y, pch = c(21, 19)[d$f])
> legend("topleft", legend = c("C", "T"), pch = c(21, 19))
```

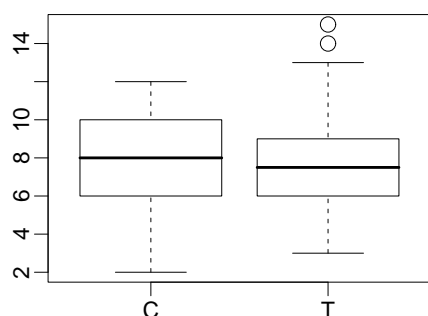


横軸を因子型の `f` 列とした場合の表示はこうなります.

25. R ではコメントマーク # から行末までは読みとばされます. ねんのため.

26. `f` 列の表示は, `C` が 50 個, `T` が 50 個ありますよ, と示しています. `factor` な `vector` を `summary()` するとカウントしてくれるんですね!

```
> plot(d$f, d$y)
```



R の `plot()` は横軸が因子型の場合は自動的に箱ひげ図<sup>27</sup> (box-whisker plot) にするんですね。

ちょっとハナシが先ばしりますが、この架空植物のデータでは上の散布図や箱ヒゲ図などで示されているように、施肥効果があまり影響してないらしいということをちょっと覚えていてください。

データを R に読みこんだら、統計モデリングだの何だのやる前に `plot()` や `summary()` などなどを使って、データの概要を把握するようにしましょう。これはデータ解析においてたいへん重要なことです。<sup>28</sup>

#### 4. 統計モデリング: `glm(..., family = poisson)`

さて、統計モデリングです。ここでやりたいことは `d` の `y` 列にある個体ごとの種子数がサイズ `x` や施肥処理 `f` にどう影響されているのか (あるいはされていないのか)、種子数のばらつきも含めて統計モデルのひとつである一般化線形モデルとして表現したい、ということです。

個体  $i$  の種子数  $y_i$  は

- 0 個, 1 個, 2 個と数えられるカウントデータ
- 値に上限があるのか (このデータからは) はっきりしない

ということで、前回紹介したポアソン分布を部品とする統計モデルが作れそうです。ある個体  $i$  の種子数の平均が

$$\lambda_i = \exp(\beta_1 + \beta_2 x_i)$$

このようにサイズ  $x_i$  を使ってかける、と仮定します。先ほどの図をみると施肥効果  $f_i$  はあまり種数に影響なさそうなので、ここでは無視します。<sup>29</sup>

27. ハコの上中下はそれぞれ 75%, 50%, 25% 点, 上下のヒゲの範囲が (おおよその) 上下 2.5% 点, マルはその (おおよその) 95% 区間からはみだしたデータ, をあらわしています。

28. またこのときに、データ列どうしの割り算値などでちあげて作図するのはあまりおススメできません。

29. あとから  $f_i$  を入れたモデルなども登場します。

上の平均種子数は

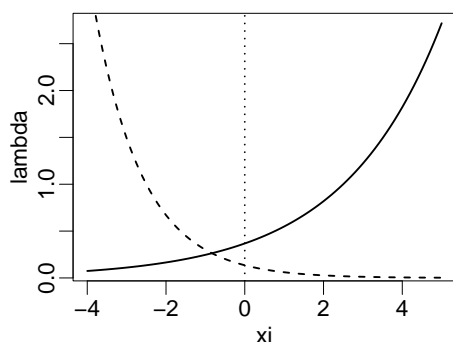
$$\log \lambda_i = \beta_1 + \beta_2 x_i$$

というふうにも書けますから，link 関数 は log link 関数で線形予測子 は  $z = \beta_1 + \beta_2 x_i$  となっている，とわかると思います．

なぜ log link 関数をここで持ち出すのでしょうか？ それはそうすると「計算に都合よく」かつ「わかりやすい」からです．ポアソン分布の平均パラメーター  $\lambda_i$  はつねに  $\lambda_i > 0$  でなければなりません． $\lambda_i = \exp(z_i)$  というふうに線形予測子  $z (= \beta_1 + \beta_2 x_i)$  を  $\exp()$  で囲っておけば  $z$  がどんな値をとろうとも， $\lambda_i$  はつねに非負の値となります．<sup>30</sup>

30. 下の例は  $\lambda_i$  をてきとくに計算させている例で， $\beta_1, \beta_2, x_i$  がどんな値をとろうとも， $\lambda_i \geq 0$  である，と示しています．

```
> xi <- seq(-4, 5, 0.1)
> plot(xi, exp(-1 + 0.4 * xi), type = "l", ylab = "lambda", lwd = 2)
> lines(xi, exp(-2 - 0.8 * xi), lwd = 2, lty = 2) # 破線
> abline(v = 0, lwd = 2, lty = 3)
```



また「わかりやすい」というのは要因の影響が積で表される，ということです．これはあとで施肥処理の効果も入れたモデルを検討するときに説明します．

確率分布の平均を  $\lambda_i = \exp(\beta_1 + \beta_2 x_i)$  にしよう，ときめたのである個体  $i$  で種子数が  $y_i$  である確率はポアソン分布の確率密度関数を使って

$$p(y_i | \{\beta_j\}, \{x_i\}) = \frac{\lambda_i^{y_i} \exp(-\lambda_i)}{y_i!}$$

と書けます．全個体の尤度は

$$L(\{\beta_j\} | \{y_i\}, \{x_i\}) = \prod_{i=1}^{100} \frac{\lambda_i^{y_i} \exp(-\lambda_i)}{y_i!}$$

対数尤度は

$$\log L(\{\beta_j\} | \{y_i\}, \{x_i\}) = \sum_{i=1}^{100} \log \left\{ \frac{\lambda_i^{y_i} \exp(-\lambda_i)}{y_i!} \right\}$$

これを最大化するような  $\hat{\beta}_1$  と  $\hat{\beta}_2$  を求める, というのが一般化線形モデル (GLM) のパラメーターの最尤推定, ということになります.

R ではたいへんお手軽に GLM のパラメーター推定ができるようになっていて,

```
> fit <- glm(y ~ x, data = d, family = poisson)
```

とすることでモデルのあてはめ (fitting) とその推定結果<sup>31</sup> が (またしても私がてきとうに名づけた) fit なるオブジェクトに格納されます.

31. だけでなくその他いろいろなものが興味があるヒトは names(fit) としてみてください.

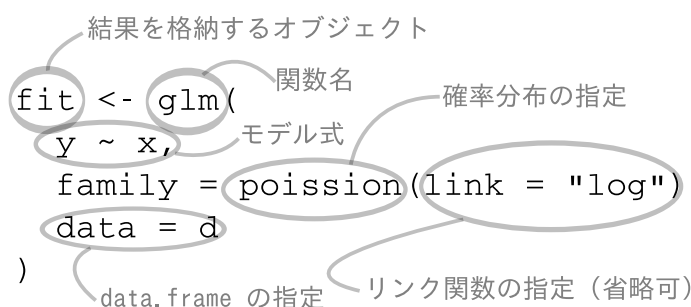


図 5: glm() 関数の指定

いろいろ指定している内容は図 5 のとおりなのですが ここで family = poisson は「分布はポアソン分布を使ってね」という指示です. これは正式には family = poisson(link = "log") というように link 関数も指定すべきなのですが, poisson family における default link function<sup>32</sup> は "log" なので log link 関数を使いたいときはとくにわざわざ指定する必要ありません.

32. あるいは canonical link function (正準 link 関数), あとでまた出ます.

それでは fit を表示してみると

```
> fit # これはいつもと同じく print(fit) した場合と同じ動作です
```

```
Call:  glm(formula = y ~ x, family = poisson, data = d)
```

```
Coefficients:
```

```
(Intercept)          x
  1.29172         0.07566
```

```
Degrees of Freedom: 99 Total (i.e. Null);  98 Residual
```

```
Null Deviance:      89.51
```

```
Residual Deviance: 84.99      AIC: 474.8
```

さらに `summary()` 関数を使うと、もっと詳細な推定結果を表示してくれます。

```
> summary(fit)

Call:
glm(formula = y ~ x, family = poisson, data = d)

Deviance Residuals:
    Min       1Q   Median       3Q      Max
-2.3679 -0.7348 -0.1775  0.6987  2.3760

Coefficients:
            Estimate Std. Error z value Pr(>|z|)
(Intercept)  1.29172    0.36369   3.552 0.000383 ***
x             0.07566    0.03560   2.125 0.033580 *
---
Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1

(Dispersion parameter for poisson family taken to be 1)

    Null deviance: 89.507  on 99  degrees of freedom
Residual deviance: 84.993  on 98  degrees of freedom
AIC: 474.77

Number of Fisher Scoring iterations: 4
```

さてさて あちこちに Deviance なるコトバが登場しますが、これについてはまたあとで説明することにしましょう。さて、上の `summary()` 出力のなかで係数 (coefficient) の情報が示されている部分、

```
Coefficients:
            Estimate Std. Error z value Pr(>|z|)
(Intercept)  1.29172    0.36369   3.552 0.000383 ***
x             0.07566    0.03560   2.125 0.033580 *
```

あたりの読みかただけを先に簡単に説明してみましよう。まず Coefficients (係数) というのは推定したいパラメーター、つまり (Intercept) (「切片」) に対応する係数は (さきほどの定式化でいうと)  $\beta_1$  で  $x$  に対応する係数は  $\beta_2$  ということです。

Estimate は前回の講義でもでてきた推定値のことで、つまりこの場合ですと最尤推定値、 $\hat{\beta}_1 \approx 1.29$  で  $\hat{\beta}_2 \approx 0.0757$  ということです。

さてこれの次からアヤしい世界に突入するのですが Std. Error はパラメーターの標準誤差の推定値です。「標準誤差とは何か?」なんてことをマジメに議論するとけっこうたいへんなので、ここでは「最尤推定値は得られたけど、じつはデータをちょっと変えると推定値もけっこう変わるんだよね、その推定値のばらつき」ぐらいのいいかげんな理解ですませることに

しましょう。この場合ですと  $\hat{\beta}_1$  の標準誤差がでかくて、 $\hat{\beta}_2$  の標準誤差が小さいみたいだ、つまり  $\hat{\beta}_1$  のほうがふらつくのね、といった意味だと思ってください。

なぜこれが「アヤしい」かといえは、標準誤差の推定計算にある方法<sup>33</sup>を使っているのですが、ホントにそれでいいのか？という疑問があるからです。だからといって他にいい方法がないのでたいていの統計ソフトウェアではそれを採用しています。

で、めんどろなことにこの標準誤差 (SE) は最尤推定値に比例するといったハナシもあるので、z value<sup>34</sup>なる (最尤推定値) / SE と定義される割算値 (Wald 統計量) を計算しています。そのココロをてきとーに図示してみますと図6のごとくで、 $\hat{\beta}_*$  たちがゼロから十分に離れているかどうか、「 $\hat{\beta}_1$  は SE のわりにはゼロから離れてるね」「 $\hat{\beta}_2$  ゼロに近いわかりには SE がでかいね」ぐらいのキモチをを表現しているわけです。で、これを「検定」しようというのが Wald 検定<sup>35</sup>なるもので、 $\Pr(>|z|)$  ってのは z value の絶対値というか  $\hat{\beta}_*$  の「分布のスソ」がゼロにどれくらいかかっているか、をあらわしてます。

で、<sup>36</sup> 私はこの係数 (パラメーターの推定値) の Wald 検定なるものはアテにならないいいかげんなもの、R の `summary(glm(...))` で出てくるのは、まあちょっとした「めやす」みたいなモノ、だと考えてます。<sup>37</sup>

こういうアヤしげな「検定」より重要なことは、推定結果を使って統計モデルの予測 (prediction) がいかなるものか、を見てみることです。R で図示してみると

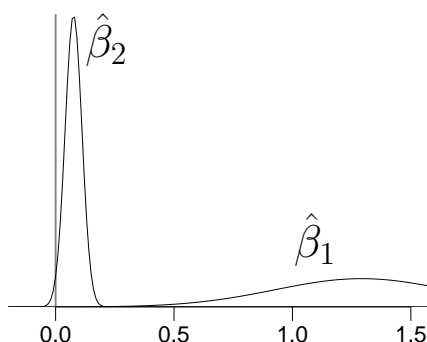


図 6: 最尤推定値の分布?

33. 最尤推定値付近での対数尤度の「とがりかた」から最尤推定値の「標準偏差」を推定していません。

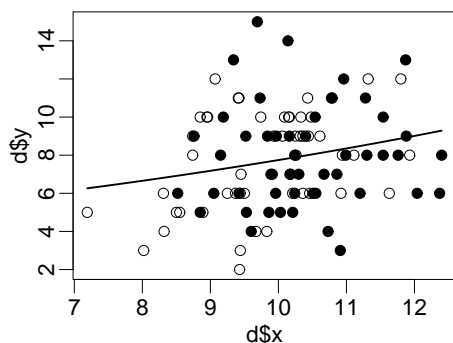
34. これはさきほど線形予測子を定義してた  $z$  とは無関係です。

35. 考えてみると、これってふつーの (Neyman-Pearson 的なわくぐみ) の検定ではありませんね。信頼区間を評価というか

36. このあたりの私のイヤイヤな口調からわかるように

37. あるパラメーターがゼロと見なすべきかどうかはあとで登場するモデル選択の手法で決めてしまえばよいのです。

```
> plot(d$x, d$y, pch = c(21, 19)[d$f])
> xx <- seq(min(d$x), max(d$x), length = 100)
> lines(xx, exp(1.29 + 0.0757 * xx), lwd = 2)
```



ここで「予測された平均種子数」は `lines(xx, exp(1.29 + 0.0757 * xx), lwd = 2)` というふうに推定値を代入して平均値  $\lambda$  を計算しています。これがめんどくさければ、

```
> yy <- predict(fit, newdata = data.frame(x = xx), type = "response")
> lines(xx, yy, lwd = 2)
```

というふうに `predict()` 関数を使う、というよりお手軽な手法なんかもあります。

最尤推定値は対数尤度  $\log L(\{\beta_j\} \mid \text{データ})$  を最大化するような  $\{\hat{\beta}_i\}$  です。つまり  $\{\hat{\beta}_i\}$  のもとでは対数尤度  $\log L(\{\beta_j\} \mid \text{データ})$  は最大化されていません。このモデルで最大化された対数尤度は `logLik(fit)` で評価することができます。

```
> logLik(fit) # fit <- glm(y ~ x, ...)
'log Lik.' -235.3863 (df=2)
```

最大化された対数尤度は -235.4 ぐらい、とわかります。(df=2) ってのは使っているパラメーター数、つまり  $\beta_1$  と  $\beta_2$  の 2 個つかってますよ、ということですね。

## 5. 因子型の説明変数の場合

ここまでは「図にしたときのわかりやすさ」を重視して、説明変数が「植物のサイズ」こと  $x_i$  だけのモデルについて説明してきました。

次に「なかったこと」あつかいだった施肥効果  $f_i$  だけをくみこんだモデ

ルも説明してみましょう。前に示したように  $f$  列は因子 (factor) 型になっていますが、

```
> d$f
 [1] C C C C C C C C C C C C C C C C C C C C C C C
 [26] C C C C C C C C C C C C C C C C C C C C C C C
 [51] T T T T T T T T T T T T T T T T T T T T T T T
 [76] T T T T T T T T T T T T T T T T T T T T T T T
Levels: C T
```

R の `glm()` のありがたいところは、説明変数がどういう型だろうが<sup>38</sup> とくに何もせずに同じように統計モデルを指定できるところにあります。その指定と推定結果をながめてみましょう。

38. とはいえ numeric, integer, factor に限定されますが。

```
> fit.f <- glm(y ~ f, data = d, family = poisson)
> fit.f

Call:  glm(formula = y ~ f, family = poisson, data = d)

Coefficients:
(Intercept)          fT
    2.05156         0.01277

Degrees of Freedom: 99 Total (i.e. Null);  98 Residual
Null Deviance:      89.51
Residual Deviance: 89.48      AIC: 479.3
```

このようにモデルの指定は説明変数が因子型であっても `glm(y ~ f, ...)` とすればよいのです。また Coefficients 出力をみると (Intercept) (「切片」) は先ほどと同じですが、施肥効果  $f$  の係数の名前は  $fT$  になっています。これは  $f$  には  $C$  (肥料なし) と  $T$  (施肥処理) の 2 水準があり (順番もこのとおり)、1 番目の水準である  $C$  を基準つまりゼロとおき、2 番目以降<sup>39</sup> の水準の「ずれ」をみてやろう、ということです。つまり、もし個体  $i$  の  $f$  が  $C$  ならば

$$\lambda_i \approx \exp(2.05 + 0) = \exp(2.05)$$

であり、もし  $T$  ならば

$$\lambda_i \approx \exp(2.05 + 0.0128) = \exp(2.0628)$$

である、という予測になります。ここでは「肥料をやると種子数がほんの少しだけ増える」という予測になっています。

このモデルで最大化された対数尤度はこうなっています。

39. ここでは 2 番目までしかありませんが。



```
> logLik(fit.f) # fit.f <- glm(y ~ f, ...)
'log Lik.' -237.6273 (df=2)
```

## 6. 説明変数が数量型 + 因子型のモデル

施肥効果  $f$  はごく簡単に `glm()` であつかえたので、だったらサイズ  $x$  というしよに統計モデル化、つまりサイズと施肥効果が同時に種子数に影響をあたえるモデルなんかの推定計算もできるのでは、というのがこれになります。

```
> fit.full <- glm(y ~ x + f, data = d, family = poisson)
> fit.full

Call:  glm(formula = y ~ x + f, family = poisson, data = d)

Coefficients:
(Intercept)          x          fT
    1.26311      0.08007     -0.03200

Degrees of Freedom: 99 Total (i.e. Null);  97 Residual
Null Deviance:      89.51
Residual Deviance: 84.81      AIC: 476.6
```

こんどは肥料の効果  $fT$  がマイナスだと推定されていますね。

それはともかくとして、先ほどから放置していた問題「log link 関数では要因の効果が積であらわされる」ということの解釈についてここで説明したいと思います。

上の推定結果があらわしていることは、もし個体  $i$  のサイズを  $x_i$  とすると、施肥処理が C ならば

$$\lambda_i \approx \exp(1.26 + 0.08x_i)$$

であり、もし T ならば

$$\lambda_i \approx \exp(1.26 + 0.08x_i - 0.032)$$

という予測になっています。これからわかるように

$$\begin{aligned} \exp(1.26 + 0.08x_i - 0.032) &= \exp(1.26 + 0.08x_i) \times \exp(-0.032) \\ &= (\text{切片とサイズ}) \times (\text{施肥処理の効果}) \end{aligned}$$

となっていますから、施肥処理の効果は `glm(y ~ x + f, ...)` と定義したにもかかわらず、足し算できているのではなくかけ算で影響してくる、とい

うことです。この場合ですと  $\exp(-0.032) \approx 0.969$  ですから、肥料をやると種子数の平均が 0.969 倍になるという予測になります。

このモデルで最大化された対数尤度はこうなっています。

```
> logLik(fit.full) # fit.full <- glm(y ~ x + f, ...)
'log Lik.' -235.2937 (df=3)
```

## 7. Deviance って何なの？

さてさて、ここまで

- サイズの効果のみのモデル
- 施肥効果のみのモデル
- サイズの効果 × 施肥効果のモデル

を調べてきてサイズの効果はともかく、施肥効果については首尾一貫しない結果が得られました。いったいどのモデルが「よい」のでしょうか？ それを決めるのがモデル選択でこれは「あてはまりの良さ」と「モデルの複雑さ」のかねあいを決まります。そして「あてはまりの良さ」とは、この最尤推定法の世界においては最大化された対数尤度があらわしています。<sup>40</sup>

モデル選択にハナシをすすめる前に、ここまで登場してきたけれどトバされていた最大化された対数尤度、つまり deviance について検討してみましよう。<sup>41</sup>

最尤推定値は対数尤度  $\log L(\{\beta_j\} \mid \text{データ})$  ..... えーい書くのがめんどうなので  $\log L$  を最大化するような  $\{\hat{\beta}_i\}$  です。このように最大化された対数尤度を  $\log L^*$  としましょうか。モデルごとの  $\log L^*$  の大小を比較すれば、どのモデルがあてはまりがよいか、といったことが検討できそうです。

しかしながら、ここまで示してきた `summary(glm(y ~ x + f, ...))` では  $\log L^*$  は示されず<sup>42</sup> そのかわり deviance なる数量が表示されています。

さて deviance はこういった目的のために対数尤度を組み合わせた指標で

$$D = -2 \log L^*$$

と定義されます。つまり対数尤度に -2 をかけているだけです。<sup>43</sup>

たとえば最初のモデル、つまり架空植物のサイズ  $x_i$  だけで平均種子数

$$\lambda_i = \exp(\beta_1 + \beta_2 x_i)$$

40. すでに各モデルごとに `logLik()` 関数で計算させてますよね。これはモデル間で比較可能な数量です.....ただし離散確率分布モデルと連続確率分布モデルの比較、といった「原理的にありえない」状況では当然ながら比較できません。

41. 訳語としては <sup>ゆとりど</sup> 尤離度 っていうのがありますが、あまり普及してないのでここでは deviance と呼びます。

42. わざわざ `logLik()` 関数を使って  $\log L^*$  を評価してみましたね。

43. なんで -2 なんかをかけるの？ というのは... まあ歴史的経緯というやつでして、この場合は尤度比検定の検定統計量と関係があります。統計学にはこういう歴史的なんちゃらがいろいろあります。

と定義されるモデルについて説明してみましょう．これを仮に「サイズだけモデル」とよびます．

サイズだけモデルの最大化対数尤度  $\log L^*$  は -235.4 ぐらいでしたから deviance ( $D = -2\log L^*$ ) は 470.8 ぐらいになります．しかしながら，このモデルの `glm()` の出力結果をみても，

```
... (中略) ...
Null Deviance:      89.51
Residual Deviance: 84.99      AIC: 474.8
```

どこにも 470.8 なる数値はでてきません．そのかわり Null Deviance だとか Residual Deviance だとか AIC といった数値が示されています．

ここで「観測データに統計モデルがあてはまっているか」をあらわしているのは Residual Deviance なので，<sup>44</sup> まずはこれについて説明してみましょう．Residual deviance はある deviance  $D$  に対して

$$D - (\text{ポアソン分布で可能な最小 } D)$$

と定義されます．<sup>45</sup> この「(ポアソン分布で可能な最小  $D$ )」ってのは何なのでしょう？ それは“full model”などと呼ばれているモデル，たとえばデータ数が 100 個ならパラメーターを 100 個 (!) 使って「あてはめた」モデルということです．<sup>46</sup>

この例題の場合ですと，`data.frame` である `d` に格納されている種子数は

```
> d$y
[1] 6 6 6 12 10 4 9 9 9 11 6 10 6 10 11 8
... (後略) ...
```

となっていました．「サイズだけモデル」はサイズ  $x_i$  で決まる平均種子数  $\lambda_i$  でこの `d$y` が説明できると考えていました．これにたいして full model は

- 1, 2, 3 個目の `y` は 6 なので平均 6 のポアソン分布
- 4 個目の `y` は 12 なので平均 12 のポアソン分布
- 5 個目の `y` は 10 なので平均 10 のポアソン分布
- ... (以下略) ...

というふうに 100 個のデータに対して 100 個のパラメーターを準備して「あてはめる」モデルです．このようなモデルはぜんぜんデータの情報を圧縮していない「種子数はどのように決まるか？」にマトモに答えていない価値の

44. Residual というのは統計学な用語で「残差」と訳されます．

45. Deviance や residual deviance は大きいほどあてはまりが悪い，つまり deviance は「あてはまりの悪さ」をあらわしています．

46. これに対して「サイズだけモデル」は  $\beta_1$  と  $\beta_2$  の 2 個しかパラメーターを思いだしてください．

ない統計モデルです。しかしこのモデルを適用したときに、対数尤度は最大化され、<sup>47</sup>

```
> sum(dpois(d$y, lambda = d$y, log = TRUE))
[1] -192.8898
```

「サイズだけモデル」の  $\log L^*$  が -235.4 でしたからこれは「ケタちがい」<sup>48</sup> に大きい最大化対数尤度になっています。対数尤度が最大化される、ということは、つまりそれは deviance  $D = -2 \log L^* \approx 385.8$  が最小化される、ということです。これが「(ポアソン分布で可能な最小  $D$ )」というもので、「サイズだけモデル」の residual deviance は

$$D - (\text{ポアソン分布で可能な最小 } D) \approx 470.8 - 385.8 = 85.0$$

となるので先に示した `glm()` のアウトプット

```
Residual Deviance: 84.99      AIC: 474.8
```

と一致していることがわかりますね。つまり residual deviance とは「すごくあてはまりが良い」場合に最小値ゼロをとるような値となります。<sup>49</sup>

それでは residual deviance の最大値はどのように決まるのでしょうか？ Residual deviance が最大になるのは「もっともあてはまりの悪いモデル」であり、それは(ポアソン分布を部品として使っているときに)「もっともパラメーター数の少ないモデル」つまり平均種子数が

$$\lambda_i = \exp(\beta_1)$$

というふうに 1 パラメーターだけで決まっているモデルです。これは R の中では “null model” と呼ばれています。<sup>50</sup> それではこの null model を使った推定計算を試みてみましょう。

```
> fit.null <- glm(formula = y ~ 1, family = poisson, data = d)
> fit.null
```

```
Call:  glm(formula = y ~ 1, family = poisson, data = d)
```

```
Coefficients:
(Intercept)
      2.058
```

```
Degrees of Freedom: 99 Total (i.e. Null);  99 Residual
Null Deviance:      89.51
Residual Deviance: 89.51      AIC: 477.3
```

ポアソン分布を仮定しているときの最大 residual deviance である 89.5 といった値が示されていて、これは null model のもとでの最大化対数尤度

47. このことから統計モデリングにおいてパラメーターを増やまくって「あてはまりの良さ」だけをひたすら追及するのは無意味らしい、という気が対数の世界ではある。

49. しかし residual deviance がゼロになるような統計モデルは、さきほどの full model ごときもので観測された現象をできるだけ簡単に説明しようとする統計モデルとしては無価値です。

50. Null というと帰無仮説 (null hypothesis) なるコトバを連想させるわけですが.....null model は「なんとなく帰無仮説的なかんじのモデル」というぐらいの意味なのでしょう。

```
> logLik(fit.null) # fit.null <- glm(y ~ 1, ...)
'log Lik.' -237.6432 (df=1)
```

から算出されています。

じつは null model の residual deviance は他のモデル，たとえば「サイズだけモデル」の `glm()` アウトプットにも含まれていて，

```
... (中略) ...
Degrees of Freedom: 99 Total (i.e. Null); 98 Residual
Null Deviance:      89.51
Residual Deviance: 84.99      AIC: 474.8
```

この Null Deviance というのがそれに該当します。つまりこれは

- 「サイズだけモデル」の residual deviance は 85.0 ぐらい
- 説明変数何もないモデルの residual deviance 89.5 ぐらい
- ということで，サイズ  $x_i$  という説明変数を追加することで residual deviance が 4.1 ぐらい<sup>51</sup> 改善されたね

51. これはモデル間の対数尤度の差になります。

といったことを示しているわけです。

ついでに (最尤推定後も残されている) degree of freedom (自由度) に関する

```
Degrees of Freedom: 99 Total (i.e. Null); 98 Residual
```

このアウトプットもいまや理解できるわけで，

- Null model の (残されている) 自由度は 99 (データ数 100 - パラメーター数 1)
- 「サイズだけモデル」の自由度は 98 (100 - パラメーター数 2)

という意味です。ここまで登場したモデルのパラメーター数 ( $k$ )，最大化対数尤度 ( $\log L^*$ )，deviance ( $D = -2 \log L^*$ )，residual deviance ( $-2 \log L^* -$  最大  $D$ ) をまとめてみます。

| Model | $k$ | $\log L^*$ | Deviance<br>$-2 \log L^*$ | Residual<br>deviance |
|-------|-----|------------|---------------------------|----------------------|
| NULL  | 1   | -237.6     | 475.3                     | 89.5                 |
| f     | 2   | -237.6     | 475.3                     | 89.5                 |
| x     | 2   | -235.4     | 470.8                     | 85.0                 |
| x + f | 3   | -235.3     | 470.6                     | 84.8                 |
| FULL  | 100 | -192.9     | 385.8                     | 0.0                  |

この table をみると、パラメーター数さえ増やせば residual deviance はどんどん小さくなる、つまり「あてはまりが良くなる」ことがわかります。

## 8. 「よい」モデルを選ぶモデル選択

統計モデルにおいて「あてはまりの良さ」つまり対数尤度の最大化 (= deviance の最小化) だけをひたすらおもしろいとめるのはどうもへんらしい、ということが先ほどの full model の検討でわかってきました。<sup>52</sup>

統計モデリングでは

- できるだけ最大化対数尤度が大きいあてはまりのよいモデル
- できるだけパラメーター数が少ない簡単なモデル

という矛盾したふたつの要求をバランスよく満たすような統計モデルを見つけることをモデル選択 (model selection) とよび、このときにモデルのよしあしを決めるのがモデル選択規準です。たとえば良く使われてるモデル選択規準 AIC (Akaike's information criterion) は

$$\begin{aligned} \text{AIC} &= -2(\text{最大化対数尤度}) + 2(\text{そのモデルで使ってるパラメーター数}) \\ &= -2 \log L^* + 2k \end{aligned}$$

と定義され、これが一番小さいモデルがよいモデルとして選択されます。今回登場したいろいろなポアソン分布モデルについて AIC を評価してみると、

| Model | $k$ | $\log L^*$ | Deviance<br>$-2 \log L^*$ | Residual<br>deviance | AIC   |
|-------|-----|------------|---------------------------|----------------------|-------|
| NULL  | 1   | -237.6     | 475.3                     | 89.5                 | 477.3 |
| f     | 2   | -237.6     | 475.3                     | 89.5                 | 479.3 |
| x     | 2   | -235.4     | 470.8                     | 85.0                 | 474.8 |
| x + f | 3   | -235.3     | 470.6                     | 84.8                 | 476.6 |
| FULL  | 100 | -192.9     | 385.8                     | 0.0                  | 585.8 |

となり、「サイズだけモデル」(Model x) があてはまりの良さとモデルの単純さを兼ねそなえた「よい」統計モデルとして選ばれました。<sup>53</sup>

次のページに示していますが、R では `stepAIC()` 関数を使うことで、手軽に AIC による `glm()` のモデル選択ができます。

52. 正規分布を使った回帰などで  $R^2$  最大化をひたすら追求するのも同様にばかばかしいことです。

53. ヒトことだけ説明するなら、あてはまりではなく「予測力がよい」という意味で「よい」モデルなのです。

```

> library(MASS) # stepAIC を定義する MASS package よみこみ
> stepAIC(fit.full) # 「全部いりモデル」を使う
Start:  AIC=476.59
y ~ x + f

          Df Deviance    AIC
- f      1     84.99 474.77
<none>   1     84.81 476.59
- x      1     89.48 479.25

Step:  AIC=474.77
y ~ x

          Df Deviance    AIC
<none>   1     84.99 474.77
- x      1     89.51 477.29

Call:  glm(formula = y ~ x, family = poisson, data = d)

Coefficients:
(Intercept)                x
      1.29172         0.07566

Degrees of Freedom: 99 Total (i.e. Null);  98 Residual
Null Deviance:      89.51
Residual Deviance: 84.99      AIC: 474.8

```

モデル選択については次の回 & 次の次の回でさらにとりあげていく予定なので、今日のところはこれぐらいで終わることにしましょう。

## 9. 今日のまとめ

今日は以下にあげているようなことを説明してみました。

- 一般化線形モデル (GLM) はポアソン回帰・ロジスティック回帰・正規分布を仮定する直線回帰や (いわゆる) ANOVA を統合した呼びかたである
- R では `glm()` 関数でまとめてあつかえる
- GLM の基本部品: 確率分布・link 関数・線形予測子
- ポアソン回帰は確率分布 = ポアソン分布 (poisson), link 関数 = log
- `glm()` 関数は GLM のパラメータを最尤推定する

- 推定結果を使って予測 (prediction) ができる
- Deviance は  $-2 \times$  最大化対数尤度, あてはまりの悪さ
- $AIC = Deviance + 2 \times (\text{パラメーター数})$ , あてはまりの良さとパラメーター数の「バランス」をとる

次回はまた別の「正規分布では説明できない現象の統計モデリング」として, 二項分布と logit link 関数を使う GLM であるロジスティック回帰について説明します.