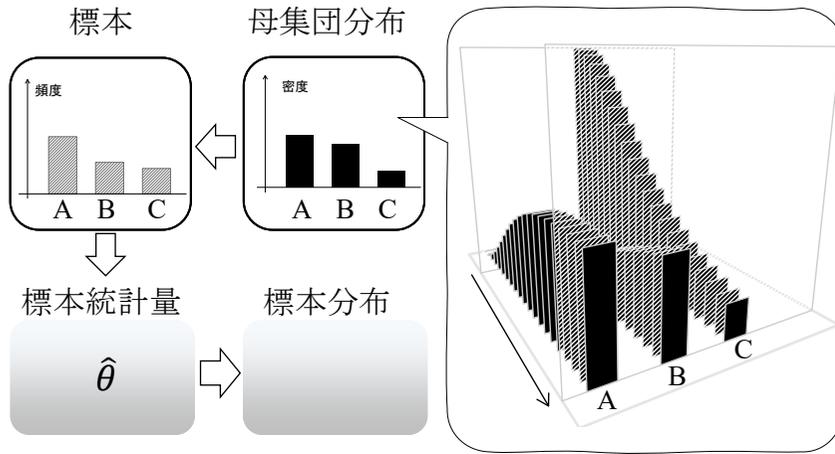


学びのポイント

- 粗頻度を従属変数とし、その値を独立変数たちから予測するモデルの一つに、ポワソン回帰が存在することが分かる。
- ポワソン回帰の構造を数式で表現することができる。
- ポワソン回帰のパラメータは負の値を取らず、この制約を満たすため、ポワソン回帰のリンク関数には対数リンクを用いることが分かる。
- 重回帰モデル、ロジスティック回帰モデル、およびポワソン回帰モデルは、独立変数の線形結合と、母集団確率分布の平均を、リンク関数を介してつなげているという点で共通した構造を持ち、このような構造を持つ統計モデルを一般化線形モデルと呼ぶことが分かる。
- 「単位〇〇あたりの頻度」の期待値をモデル化したいときには、オフセット項つきのポワソン回帰を用いることが分かる。

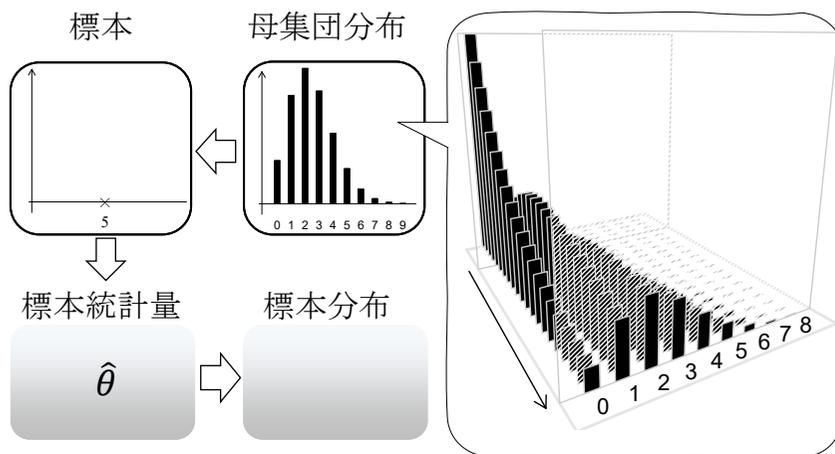
見取り図

【第2講】ロジスティック回帰モデル



【第3講】ポワソン回帰モデル

- ☞ ノート0：基本的な考え方
- ☞ ノート1：統計モデル
- ☞ ノート2：統計モデル（オフセット項）



■ 目標

第2講であつかったロジスティック回帰モデルは、リンク関数を用いて、独立変数の線形結合をベルヌーイ分布／二項分布の期待値パラメータと結びつける統計モデルでした。このように、リンク関数を母集団確率分布の期待値に結びつける構造を持つ統計モデルを一般化線形モデルと呼びます。

この第3講では、一般化線形モデルの別のモデルとしてポワソン回帰を学びます。これは、ポワソン分布の期待値パラメータ λ と独立変数たちを、対数リンク関数で結び付けたものです。

同じ一般化線形モデルということで、推定方法も最尤推定法を用いたりすると、基本的な統計推論のパターンは第2講のものと全く同じです。そこで、この第3講では、重複する部分は割愛し、ポワソンモデルの特徴である統計モデルの作り方に焦点を当て、どのような考え方で、このモデルを立て、使用するのかに注目して議論を進めます。

○目的



回帰分析と同じやりかたで、
従属変数がカウントデータの場合も扱いたい！

イメージ

	点推定値	標準誤差	p 値
切片	1.20	0.11	0.00 ***
回帰係数 1	-2.11	0.21	0.00 ***
回帰係数 2	0.80	0.33	0.02 *



音韻論における利用例

① モチベーション

それぞれの言語にいくつの音素が存在するか予測したい！

② 例

それぞれの言語が持つ音素の数を (a) その言語が属する語族、(b) 話者の人口等から予測する。



第二言語教育における利用例

① モチベーション

英語を学んでいる学習者が間違いを起こす回数を、その学習者の特徴から予測、説明したい！

② 例

自由作文を実施し、その中で英語のスペルを間違えた数を (a) 学習者のレベル、(b) 作文のテーマなどから予測する。



社会言語学における利用例

① モチベーション

フィラーが生産される回数を社会要因等から説明したい！

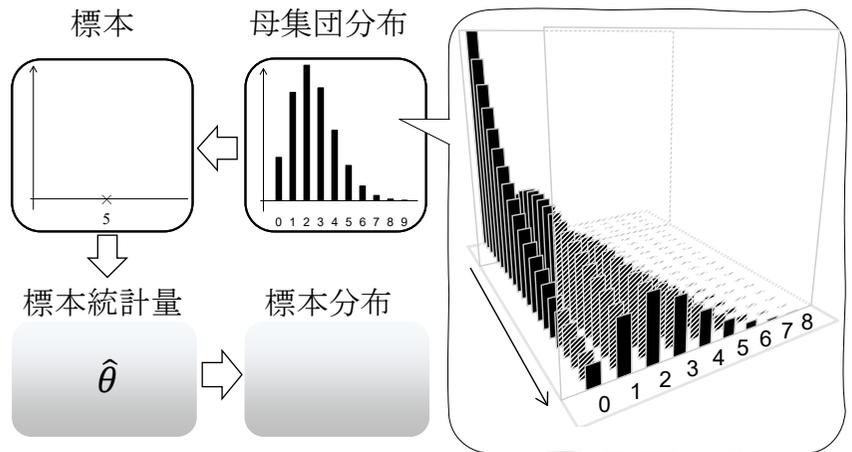
② 例

「えー／あー」などのフィラーの生産回数を (a) 発話時のフォーマルさ、(b) 話者の性別、(c) 話者の社会階層等から予測する。

○ ポイント



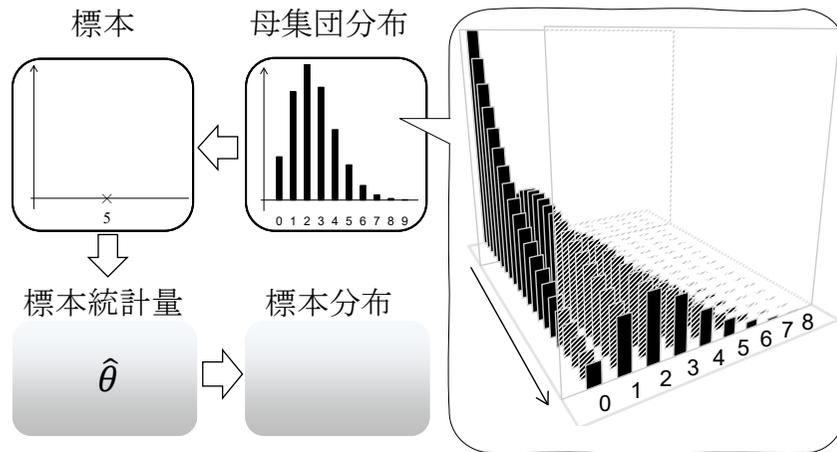
独立変数をもとに母集団の確率を 構造化 する!



○目的



「ノート0」のアイデアを数式で表現する！



(1) パート1：母集団分布からの標本抽出

$$y_i \sim Po(\lambda_i)$$

(2) パート2：独立変数たちの線形結合を作る

$$\eta_i = \beta_0 + \beta_1 x_{1i} + \dots + \beta_n x_{ni}$$

(3) パート3：リンク関数 Link Function

$(-\infty, \infty)$ の値を取る η_i から、 $(0, \infty)$ の値を取る λ_i へ、(a) 一対一で、(b)滑らかに、変換する関数のこと。

$$\lambda_i = F(\eta_i)$$

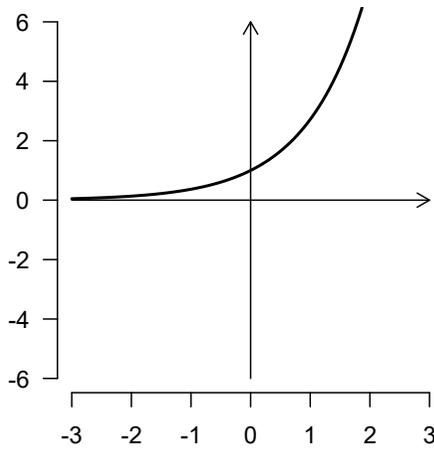
$$G(\lambda_i) = \eta_i$$

ポワソン分布では、Fに指数関数。Gに対数関数を用いる。

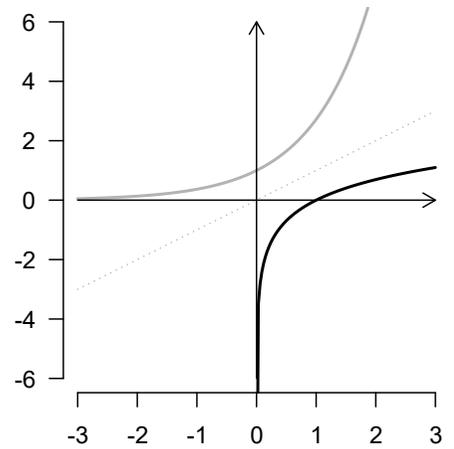


指数関数と対数関数

指数関数



対数関数



まとめ：一般化線形モデル

① ポワソン回帰

$$y_i \sim Po(\lambda_i)$$

$$\lambda_i = \exp(\eta_i)$$

$$\eta_i = \beta_0 + \beta_1 x_{1i} + \dots + \beta_n x_{ni}$$

② ロジスティック回帰

$$y_i \sim Bern(\pi_i)$$

$$\pi_i = \frac{\exp(\eta_i)}{1 + \exp(\eta_i)}$$

$$\eta_i = \beta_0 + \beta_1 x_{1i} + \dots + \beta_n x_{ni}$$

③ 重回帰

$$y_i \sim N(\mu_i, \sigma^2)$$

$$\mu_i = \eta_i$$

$$\eta_i = \beta_0 + \beta_1 x_{1i} + \dots + \beta_n x_{ni}$$

※ 前期に習った重回帰分析はリンク関数が恒等関数 (Identity function) である場合だと考えられる。

📖 ノート2 母集団分布：オフセット項

○目的



「頻度」ではなく、「単位〇〇あたりの頻度」を独立変数たちから予測したい！

ID (コーパス)	y_i	x_{1i} (性別)	x_{2i} (講演)	a_i (収録時間)
1	2	0	1	30分
2	3	0	1	45分
3	0	0	0	30分
4	11	0	0	300分
5	9	1	0	400分
6	7	0	1	200分
⋮	⋮	⋮	⋮	⋮

(1) 普通のポワソン回帰：粗頻度をモデル化

$$\begin{cases} y_i \sim Po(\lambda_i) \\ \lambda_i = \exp(\eta_i) \\ \eta_i = \beta_0 + \beta_1 x_{1i} + \dots + \beta_n x_{ni} \end{cases}$$

(2) オフセット項つき：単位〇〇あたりの粗頻度をモデル化

「単位〇〇あたりの平均頻度 $\frac{\lambda_i}{a_i}$ 」をモデル化する。

$$\begin{cases} y_i \sim Po(\lambda_i) \\ \lambda_i = \exp(\eta_i) \\ \eta_i = \beta_0 + \beta_1 x_{1i} + \dots + \beta_n x_{ni} + \log(a_i) \end{cases}$$



オフセット項が出てくるわけ

$$\begin{cases} y_i \sim Po(\lambda_i) \\ \frac{\lambda_i}{a_i} = \exp(\eta'_i) \\ \eta'_i = \beta_0 + \beta_1 x_{1i} + \dots + \beta_n x_{ni} \end{cases}$$

$$\Leftrightarrow \begin{cases} y_i \sim Po(\lambda_i) \\ \lambda_i = \exp(\eta'_i) \times a_i \\ \quad = \exp(\eta'_i + \log(a_i)) \\ \eta'_i = \beta_0 + \beta_1 x_{1i} + \dots + \beta_n x_{ni} \end{cases}$$

ここで、 $\eta_i = \eta'_i + \log(a_i)$ と置き換えると、

$$\Leftrightarrow \begin{cases} y_i \sim Po(\lambda_i) \\ \lambda_i = \exp(\eta_i) \\ \eta_i = \beta_0 + \beta_1 x_{1i} + \dots + \beta_n x_{ni} + \log(a_i) \end{cases}$$



オフセット項の解釈

$$\begin{aligned} \eta_i &= \beta_0 + \beta_1 x_{1i} + \dots + \beta_n x_{ni} + \log(a_i) \\ &= \beta_0 + \beta_1 x_{1i} + \dots + \beta_n x_{ni} + x_{(n+1)i} \end{aligned}$$

$x_{(n+1)i} = \log(a_i)$ とおけば、オフセット項は「偏回帰係数が常に1に固定化された独立変数だ」と解釈できる。



オフセット項の使いどころ

左ページでは、「単位時間あたり」の例を挙げたが、「単位面積あたりの何かの出現頻度」のように様々な応用が可能。



Rにおける実装

```
fit <- glm(y ~ x1 + x2, offset = log(a), data = data, family = poisson)
```