

第10講 一般線型モデル

田中重人 (東北大学文学部准教授)

[テーマ] 固定因子と共変量

1 モデルとパラメータ

前回の一般線形モデルの推定結果では、 $Q39g$ の値が次の式で近似されていることになる：

$$Q39g = \text{切片} + B_1X_1 + B_2X_2 + B_3X_3 \quad (1)$$

ただし、

- X_1 は年齢
- X_2 は初等教育のものについて1、それ以外は0とする
- X_3 は中教育のものについて1、それ以外は0とする

推定された係数 (切片と B) それぞれについて、区間推定と統計的検定がおこなわれる

2 固定因子と共変量

固定因子： 名義尺度の変数。自動的にカテゴリーに分割され、そのうちひとつが「基準」になる。推定される係数は、カテゴリー数 - 1。

共変量： 間隔尺度の変数。そのままの値が投入される。推定される係数はひとつだけ。

2.1 固定因子ひとつだけのモデル

カテゴリー別平均から係数が計算される

$$\text{初等: } 3.591 - 0.700 = 2.891$$

$$\text{中等: } 3.591 + 0.011 = 3.602$$

$$\text{高等: } 3.591 + 0.000 = 3.591 \quad \text{基準}$$

「被験者間効果の検定」に表示されるものは、平均値の比較の際に使われるものと同様であるが、用語が少し違う：

- 決定係数 $R^2 = \text{相関比}^2 = \text{edu3} / \text{修正総和}$
- $\text{edu3} + \text{誤差} = \text{修正総和}$

おなじ変数について平均値の比較をおこない、結果を照らし合わせてみよう。

2.2 共変量ひとつのモデル

最小2乗法 (least square method) で係数を求める。これは、適当な直線 $A + BX$ によって Y の値を近似する方法であり、 Y と $A+BX$ とのずれの大きさを評価するために差の2乗和をとる。この2乗和 $\sum(Y - A - BX)^2$ が最小になるように A と B の組み合わせを求める。

回帰係数 B の意味: X が1単位増えたとき Y がどれだけ増えるか

2.3 独立変数が複数の場合

- 独立変数がひとつの場合と何が異なるか?
- 「コントロール」することの意味
 - 媒介効果
 - 疑似相関
- 被験者間効果の検定 (分散分析表) から独立変数の影響力の大きさを読む

3 期末レポート

期限: 2/5 (月)

提出先: ISTU

内容: 相関係数、対応のある分析、多変量解析について、それぞれ適当な分析をして結果を解釈する。
すべての分析について、推定または検定結果をつける。データは何を使ってもよいが、SSM データ以外のものを使うときはデータについての説明をつけること。

備考: レポート提出後に、SSM データのコピーをすべて消去すること。レポートは、採点後に返却する。

文献

吉川徹・轟亮 (1996) 「学校教育と戦後日本の社会意識の民主化」『教育社会学研究』58:87-101.