

margins - マージン/限界効果 【 評価版 】

margins コマンドを使うと what-if タイプの分析が行えます。例えば

- 観測データがすべて男性のものだったとしたらどのような結果が得られるか？
- 男性に対して観測された属性値はそのまま性別のみ女性に変更したらどのような結果になるか？

といった分析が可能になります。

- | | |
|------------------|------------|
| 1. マージンと限界効果 | |
| 2. マージンの算出 | Example 1 |
| | Example 2 |
| | Example 3 |
| | Example 4 |
| | Example 5 |
| | Example 6 |
| | Example 7 |
| | Example 8 |
| | Example 9 |
| | Example 10 |
| | Example 11 |
| | Example 12 |
| | Example 13 |
| | Example 14 |
| | Example 15 |
| 3. 限界効果の算出 | |
| 3.1 dydx() オプション | |
| 3.2 at() オプション | |
| 3.3 弾力性 | |
| 3.4 微分と差分 | |
| | Example 16 |
| | Example 17 |
| | Example 18 |

4. サーベイデータの扱い	Example 19
	Example 20
	Example 21
5. 標準化マージン	
6. asbalanced オプション	
6.1 asbalanced によるバランスング	
6.2 標準化によるバランスング	
6.3 非線形応答のバランスング	
6.4 一部の共変量のみバランスング	
6.5 fvset design の利用	
6.6 空白セルの扱い	
7. ネスト型デザイン	
7.1 ネスト型デザインとは	
7.2 asbalanced オプションの扱い	
7.3 コード付けのスタイル	
8. 特記事項	
8.1 モデル式に関する要件	
8.2 推定可能性	
8.3 検定の操作可能性	
8.4 estimates use コマンドとの併用	
8.5 at() の構文	
8.6 例外的な推定コマンド	
9. Glossary	
補足 1	
補足 2	

1. マージンと限界効果

`margins` コマンドは `predict` 等と同様の `postestimation` 機能であり、マージン、及び限界効果を算出する機能を提供します。

- マージン (margins) – フィットされたモデルの一部、もしくはすべての共変量を固定したときに、そのモデルから導かれる統計量のことを言う。
- 限界効果 (marginal effects) – 応答変数の導関数に関するマージン。1 つの共変量の変化に対する応答変数の変化を表し、弾力性 (elasticity) と呼ばれることもある。

応答関数を $f(x)$ と書くとき、 $f(\cdot)$ の値を求めるのが前者の機能であり、 $f'(\cdot)$ の値を求めるのが後者の機能と言えます。

2. マージンの算出

応答変数のマージン (margins of responses) に対しては `predictive margins`, `adjusted predictions`, `recycled predictions` という表現が使われることがあります。またバランスの取れたデータの場合には `margins of responses` の代わりに `estimated marginal means`, `least-squares means` という用語も用いられます。

マージンとは一部、もしくはすべての共変量の値を実際とは異なる値に固定したデータセットを用いたときに、モデルによって算出される統計量のことを言います。例えば男性と女性を対象に線形回帰モデルをフィットさせたとしたときに、男性についての周辺平均 (marginal mean) — すなわち平均値のマージン — というのは、すべての観測データを男性とみなしたときに得られる従属変数の予測される平均値のことを言います。従って実際に男性を表す観測データの他に女性を表す観測データも計算の対象に含まれることとなります。女性についての周辺平均も同様に、すべての観測データが女性を表すものとして計算されます。

計算に際してはモデル中に現れる性別に関する項がすべて男性、または女性として扱われます。例えば

```
. regress y age bp i.sex sex#c.age sex#c.bp
```

といったモデルをフィットさせたとして、男性や女性についてのマージンを計算する場合、`margins` は `i.sex` という直接的な効果のみならず、`sex#c.age` や `sex#c.bp` といった間接的な効果についても考慮に入れて計算を行います。

マージンの計算対象となる応答値は `predict` によって算出される任意の統計量 (もしくはそれらを含む任意の数式) であって構いません。

デフォルトの場合、標準誤差はデルタ法によって算出されます。この手法の場合、共変量の評価を行う値は固定値であることが仮定されます。`svy` を用いるか否かによらず、標本がある集団を表す場合に、`vce(unconditional)` オプションを指定すれば、サンプリングに伴う共変量値の変動を考慮した標準誤差が算出されます。これを `predictive margins` と呼ぶ研究者もいます。

以下にいくつかの用例を紹介しますが、使用する Example データセットは `margex.dta` です。

```
. use http://www.stata-press.com/data/r14/margex.dta *1
(Artificial data for margins)
```

変数に対してはラベル情報が付加されていないので余り役には立ちませんが、一応変数の一覧を掲載しておく
と次のようになります。

```
. describe *2
```

```
. describe

Contains data from http://www.stata-press.com/data/r14/margex.dta
  obs:           3,000                Artificial data for margins
  vars:           11                27 Nov 2014 14:27
  size:          78,000
```

variable name	storage type	display format	value label	variable label
y	float	%6.1f		
outcome	byte	%2.0f		
sex	byte	%6.0f	sexlbl	
group	byte	%2.0f		
age	float	%3.0f		
distance	float	%6.2f		
ycn	float	%6.1f		
yc	float	%6.1f		
treatment	byte	%2.0f		
agegroup	byte	%8.0g	agelab	
arm	byte	%8.0g		

```
Sorted by: group
```

観測データ件数は 3,000 件であることが示されています。

*1 メニュー操作 : File ▷ Example Datasets ▷ Stata 14 manual datasets と操作、Base Reference Manual [R] の margins の項よりダウンロードする。

*2 メニュー操作 : Data ▷ Describe data ▷ Describe data in memory or in a file


▷ Example 1: 線形回帰

変数 y (連続変数) を sex , $group$ (共にカテゴリ変数) によって説明する簡単な線形回帰モデルをフィットさせた後、 sex についてのマージンを計算してみます。なお、i. 演算子については *mwp-028* をご参照ください。

```
. regress y i.sex i.group *3
```

Source	SS	df	MS	Number of obs	=	3,000
Model	183866.077	3	61288.6923	F(3, 2996)	=	152.06
Residual	1207566.93	2,996	403.059723	Prob > F	=	0.0000
Total	1391433.01	2,999	463.965657	R-squared	=	0.1321
				Adj R-squared	=	0.1313
				Root MSE	=	20.076

y	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]
sex					
female	18.32202	.8930951	20.52	0.000	16.57088 20.07316
group					
2	8.037615	.913769	8.80	0.000	6.245937 9.829293
3	18.63922	1.159503	16.08	0.000	16.36572 20.91272
_cons	53.32146	.9345465	57.06	0.000	51.48904 55.15388

 $group$ については値ラベルが設定されていないのでコードの値がそのまま表示されていますが、 sex については値ラベルが表示に用いられている点に注意してください。nofvlabel オプションが指定された場合には値ラベルによる表示は抑止されます。

この状態で sex についてのマージンを算出します。

- Statistics ▷ Postestimation ▷ Marginal analysis
 - ▷ Marginal means and marginal effects, fundamental analyses ▷ Launch と操作
- margins ダイアログ: Main タブ: Covariate to compute margins, contrasts, or effects across:
 - Covariate: sex
 - Analysis type: Marginal means of outcome for levels of covariate

*3 メニュー操作: Statistics ▷ Linear models and related ▷ Linear regression

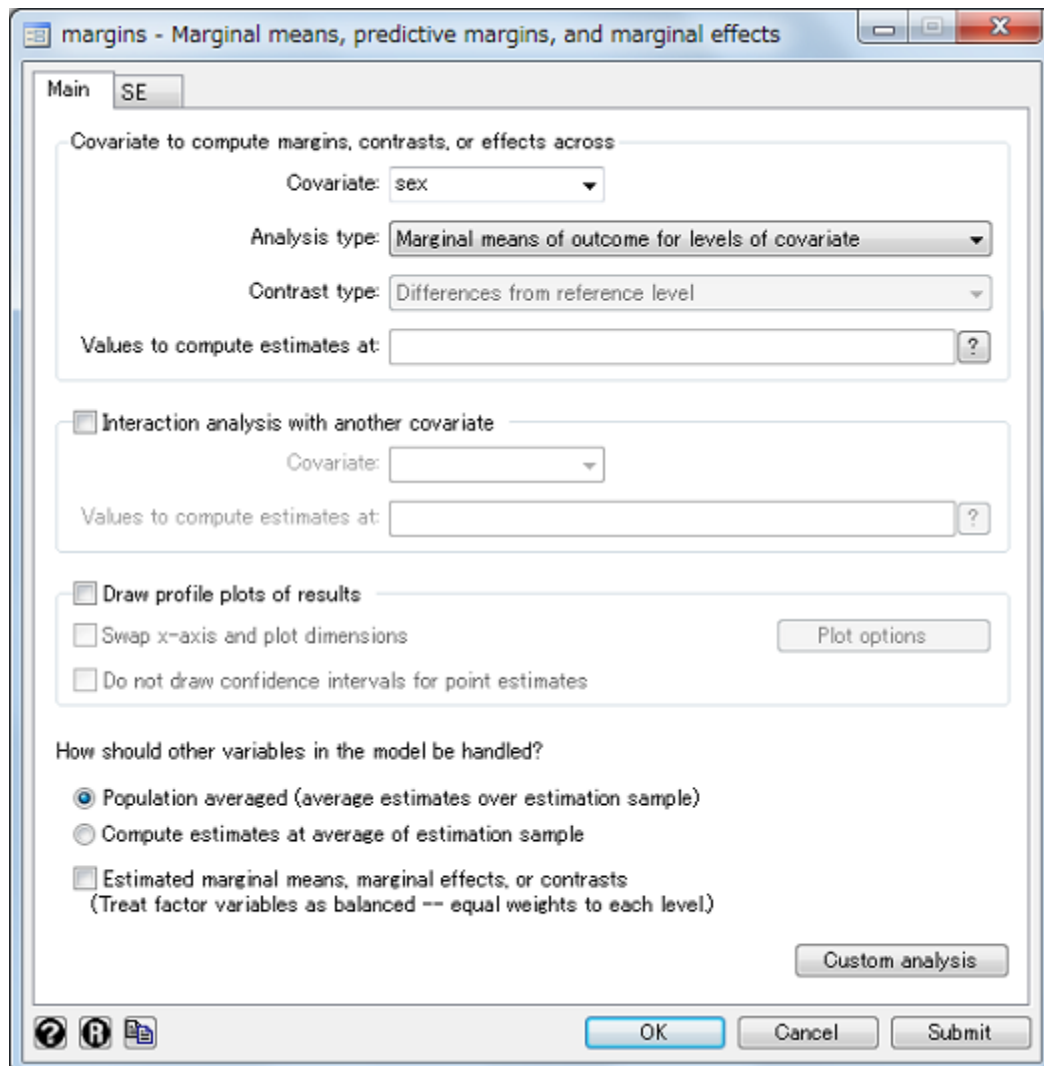


図 1 margins ダイアログ - Main タブ

```
. margins sex

Predictive margins                                Number of obs   =       3,000
Model VCE      : OLS

Expression    : Linear prediction, predict()
```

	Delta-method				
	Margin	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]
sex					
male	60.56034	.5781782	104.74	0.000	59.42668 61.69401
female	78.88236	.5772578	136.65	0.000	77.7505 80.01422

このデータセット中には男性 ($sex = 0$) のデータが 1,498 件、女性 ($sex = 1$) のデータが 1,502 件記録されています。マージンとして表示されている 60.56 という値は、3,000 件のデータがすべて男性であるとしたときにモデルで予測される y の値の平均値です。同様に 78.88 という値はすべてが女性であるとしたときにモデルで予測される y の値の平均値です。実際の男性のデータ 1,498 件を平均しても 60.56 という値は出てきませんし、女性のデータ 1,502 件を平均しても 78.88 という値は出てこない点に注意してください。

60.56 とか 78.88 というマージンの値を誘導するにはフィットされたモデル式に立ち返る必要があります。上記 regress コマンドの出力から導かれるモデル式は次のように記述できます*4。実際の推定値ではなく $_b[\]$ という記法によって係数値の参照を行っている点にご注意ください。

$$\hat{y} = _b[1.sex] \cdot 1.sex + _b[2.group] \cdot 2.group + _b[3.group] \cdot 3.group + _b[_cons]$$

これに基づきすべてが男性 ($sex = 0$) であるとしたときのモデルによる予測値 y_0 を算出してみます。

```
. generate y0 = _b[1.sex]*0 + _b[2.group]*2.group + _b[3.group]*3.group + _b[_cons] *5
```

同様にすべてが女性 ($sex = 1$) であるとしたときの予測値 y_1 を算出します。

```
. generate y1 = _b[1.sex]*1 + _b[2.group]*2.group + _b[3.group]*3.group + _b[_cons]
```

これら y_0 と y_1 の平均値を求めてみます。

```
. summarize y0 y1 *6
```

Variable	Obs	Mean	Std. Dev.	Min	Max
y0	3,000	60.56034	7.126508	53.32146	71.96069
y1	3,000	78.88236	7.12651	71.64348	90.28271

margins コマンドによる出力が誘導できていることが確認できました。 ◀

▷ Example 2: ロジスティック回帰

評価版では割愛しています。

▷ Example 3: atmeans オプション

評価版では割愛しています。

▷ Example 4: 複数マージン

評価版では割愛しています。

*4 regress 出力中の female というのは値ラベルであり、その実体は 1.sex です。

*5 メニュー操作： Data ▷ Create or change data ▷ Create new variable

*6 メニュー操作： Statistics ▷ Summaries, tables and tests ▷ Summary and descriptive statistics ▷ Summary statistics

▷ Example 5: 交互作用項を含むモデル

評価版では割愛しています。

▷ Example 6: 連続変数を含むモデル

評価版では割愛しています。

▷ Example 7: 連続変数のマージン

評価版では割愛しています。

▷ Example 8: 交互作用のマージン

評価版では割愛しています。

▷ Example 9: マージンの分解

評価版では割愛しています。

▷ Example 10: マージンの対比

評価版では割愛しています。

▷ Example 11: predict() オプション

評価版では割愛しています。

▷ Example 12: 数式の指定

評価版では割愛しています。

▷ Example 13: 複数応答に対するマージン

評価版では割愛しています。

▷ Example 14: 複数方程式モデル

評価版では割愛しています。

▷ Example 15: サンプル外予測

評価版では割愛しています。

3. 限界効果の算出

評価版では割愛しています。

3.1 dydx() オプション

評価版では割愛しています。

3.2 at() オプション

評価版では割愛しています。

3.3 弾力性

評価版では割愛しています。

3.4 微分と差分

評価版では割愛しています。

▷ Example 16: 平均限界効果

評価版では割愛しています。

▷ Example 17: 全共変量に対する平均限界効果

評価版では割愛しています。

▷ Example 18: 応答曲面上での評価

評価版では割愛しています。

4. サーベイデータの扱い

本セクションについては英文マニュアルをご参照ください。

5. 標準化マージン

評価版では割愛しています。

6. asbalanced オプション

評価版では割愛しています。

6.1 asbalanced によるバランシング

評価版では割愛しています。

6.2 標準化によるバランシング

評価版では割愛しています。

6.3 非線形応答のバランシング

評価版では割愛しています。

6.4 一部の共変量のみによるバランシング

評価版では割愛しています。

6.5 fvset design の利用

評価版では割愛しています。

6.6 空白セルの扱い

評価版では割愛しています。

7. ネスト型デザイン

7.1 ネスト型デザインとは

評価版では割愛しています。

7.2 asbalanced オプションの扱い

評価版では割愛しています。

7.3 コード付けのスタイル

評価版では割愛しています。

8. 特記事項

8.1 モデル式に関する要件

評価版では割愛しています。

8.2 推定可能性

評価版では割愛しています。

8.3 検定の操作可能性

評価版では割愛しています。

補足 1 – Example 7 に対する補足

評価版では割愛しています。

補足 2 – over() オプションの意味

評価版では割愛しています。

