

“OLS”のアップデート：BLP, Balancing weight としての再解釈と Post LASSO の活用

日時： 2024年9月6日（金）10:30～17:00

場所： オンライン開催（詳細は別途ご案内）

料金： 一般 5,000 円、学生 2,500 円

講師： 川田恵介（東京大学）

定員： 35 名 ※変更の可能性あり

■本コースの内容

本コースでは、体系的な統計学/データ分析の手法に触れたことがない学生・研究者を念頭に、OLS の活用方法を紹介します。数式などは極力用いず、直感的なコンセプトの紹介と R による実装に注力します。

OLS は、さまざまな批判を受けつつも、依然として多くの応用研究で採用されています。かつて、OLS は結果変数“Y”のモデルを推定すると解釈されてきました。しかしながら、多くの応用において、推定されたモデルと“Y”の間には大きな乖離があります。

近年の理論的研究の進展は、OLS の再解釈が提案しています。OLS は、Y の平均値の近似モデルの推定、あるいは X の分布を Balance させた上での比較研究、として再解釈できるが示されています。このような再解釈は、社会科学分野における応用研究と相性がよく、より透明性の高い分析を可能にします。さらに機械学習の手法との融合が進む中で、OLS の応用上の大きな問題点であった変数・モデル定式化の選択についても、データに基づいた解決策が提案されています。

以上のような新しい解釈、およびそれに伴う新たな問題を踏まえた上で、OLS を活用すれば、より説得的な議論が展開できます。皆様のご参加をお待ちしています。

■次のような方におすすめです

- ・初めて統計学やデータサイエンスを体系的に学ぶ方
- ・OLS への理解を更新したい方
- ・しっかりとした根拠に基づいた定量的な分析を行いたい方、数理的な議論が苦手な方

■注意事項

- ・どなたでも参加可能です。
- ・ただし、SSJ データアーカイブのデータを利用した講義の場合、9 月中に利用したデータを削除して頂く必要がございます。
- ・大学または公的研究機関所属の研究者・学生（学部生も可）、SSJ データアーカイブへデータを寄託されている民間研究機関の方は、その後、研究目的で SSJ データアーカイブより申請して頂くことで利用可能です。
- ・R・R studio・必要パッケージのインストールを事前に済ませてください。登録・インストール方法を紹介した動画を事前に配布します。

■本コースの日程

- ・OLS の Best Linear Projection としての再解釈

- Post-LASSO を活用した変数選択
- OLS の Balancing weight としての再解釈
- Post-Double Selection を活用した変数選択

*進度によって内容が若干変わることがあります。