

推定結果の見方（まとめ）

用語	（日本語）	意味／説明
Dependent Variable	被説明変数（従属変数）	説明されるべき変数。
(Independent) Variable	説明変数（独立変数）	被説明変数の動きを説明するために用いる変数。
Coefficient	係数	説明変数が被説明変数に与える影響（説明変数が1単位変化したときに被説明変数がどれだけ変化するか）を表す係数。
Std. Error (of Coefficients)	係数の標準誤差	係数の推定値の標準誤差。小さいほど精度の高い推定。
t-statistic	t 値	係数の有意性（意味がある説明変数かどうか）を検定するための統計量。 t 値＝係数の推定値／係数の標準誤差。概ね2より大きければ良い。
Prob.	p 値（t 検定に基づく）	説明変数として意味の無い（係数がゼロである）確率。小さければ意味のある説明変数である（「有意」である）と判断。
R-squared	決定係数	被説明変数の動きのうち、説明変数の動きで説明できる割合＝回帰式の当てはまりの良さを示す。1が最も良い。
Adjusted R-squared	自由度修正済決定係数	説明変数の数を考慮した上で当てはまりの良さを判断するのに用いる。
S.E. of Regression	回帰の標準誤差	回帰式の誤差の標準偏差。小さい方が良い。予測の精度を測る際などに使用。
Sum Squared Resid.	残差平方和	残差（説明できずに残った部分）の2乗の和。最小二乗法はこれを最小にするように、係数の値を求める。
Log Likelihood	対数尤度	想定した回帰モデルから見て、実際に得られた標本がどの程度もっともらしいか。大きい方が良い。
Durbin-Watson Stat.	ダービン・ワトソン比	攪乱項に系列相関があるかどうかを検定する統計量。2に近ければ良い。
Akaike Info. Criterion	赤池情報量基準	回帰式の当てはまりの良さを示す。小さいほど良い。
Schwarz Criterion	シュワルツ情報量基準	回帰式の当てはまりの良さを示す。小さいほど良い。
F-statistic	F 値	回帰式が意味があるかどうかを検定する統計量。
Prob. (F-statistic)	（F 検定に基づく）p 値	回帰式が意味が無い（全ての説明変数の係数がゼロである）確率。