タレブ『まぐれ』の要約

寺尾　敦

# 第８章　あるいはとなりの億万長者でいっぱいの世界

この章では，いくつかの例を通して，生存バイアスという概念が説明される．生存バイアスとは，ある集団の中で生き残ったサンプルだけを観察することにより，集団あるいは個体の特性に関して誤った推論をしてしまうことである．

生存バイアスにだまされている例のひとつは，ニューヨークの弁護士であるマークとその妻ジャネットである．マークはアメリカに住む人（もとの集団）の中ではかなりの成功者である．しかし，彼の住むマンションには彼以上の成功者（生き残り）ばかりが住んでいるので，マークとジャネットは自分たちがみじめに思えてしまう．

生き残りを観察して，彼らが持つ特性に関して何らかの推論を行うことは危険である．もとの集団が十分に大きく，能力や性格や方略といった特性には，メンバー間で差がないとする．まったくの偶然だけによって，あるものは生き残り，あるものは負けて舞台を去る．われわれが観察できるのは生き残りだけである．生き残りに中にわれわれが見出す特性は，負けて舞台を去ったメンバーにもやはり持っていたかもしれない．たとえば，成功者に見出される楽観主義という特性は，失敗者にもあてはまる．楽観主義者は大きなリスクをとりがちで，その中でたまたま運のよかった人が生き残るにすぎない．

# 第９章　卵を焼くより売り買いする方が簡単

この章では，過去の成績や時系列データの評価における誤りあるいは危険について説明がされる．これらの誤りは，ランダム性（運）の働きを正しく評価できないために生じる．

過去の成績が優れていても，それは優秀であることの証拠だと判断することは危ない．集団が十分に大きければ，運だけで生き残るメンバーが必ず存在するからである．過去のよい成績を売り込むファンド・マネジャーが，本当に有能なのか，運だけで生き残ったにすぎないのか，見分けることはとても難しい．われわれは負けて去ったマネジャーを観察できない．当初の集団の大きさを考えなければ，生存バイアスにだまされることになる．

過去の成績が抜群によい人の将来の成績は，やはりよいかもしれないけど，平均の方向に少し近くなる可能性が高い．これは統計学での平均回帰と呼ばれる現象である．抜群の成績は少し割り引いて考えるべきである．そうした成績は運によってもたらされた部分がかなり入り込んでいる．こうした運のよさが将来も続くと考えることはできない．

過去の大量データの中から何か有用な関係を見出そうとするデータ・マイニングでは，本来は存在しない関係が見つかることがある．あらかじめ見つけようとしていた関係が確かに見つかった場合はよいが，なんでもよいから見つけようとして見つかった関係は，偶然のものである可能性が高い．

過去のデータを説明できるルールを何でもよいから見つけようとするデータ・スヌーピングにも，データ・マイニングと同じ危険がある．ランダムなデータには，まったくの偶然によって，何らかのパターンが必ず生じる．こうしたパターンに何か特別な意味を見出すことには意味がなく，誤りである．