

D-27 スパース学習による主成分回帰モデル

川野秀一
(電通大)

藤澤洋徳
(統数研)

高田豊行
(遺伝研)

城石俊彦
(遺伝研)

背景

主成分回帰モデル (2段階法)

主成分分析  主成分スコアを用いた回帰モデル

【問題点】 主成分スコアと目的変数は無関係

提案手法

主成分回帰モデル (1段階法)

回帰誤差

+

主成分誤差

+

スパース推定

スパース推定の役割

- パラメータ識別性
- 疎なパラメータ推定