

No. T-27

A note on LARS(least angle regression) in orthogonal case

Katsuyuki Hagiwara, Mie University

テーマ：直交デザイン行列の下での LARS(Efron et. al. : 2004)

LARS の性質を単純化して理解するだけでなく，ノンパラメトリック回帰の問題（例えば，wavelet denosing など）に応用できる

結果：

- ★ 貪欲法 + 縮小推定 = soft-thresholding
- ★ LASSO との関係
- ★ C_p タイプのモデル選択規準が適用可 (自由度=パラメータ数)
- ★ wavelet denoising (Donoho & Johnstone : 1994,1995) における universal thresholding や SUREshrink との関係