

Asymptotyczne własności U -procesów z karą Lasso

Wojciech Rejchel

Uniwersytet Mikołaja Kopernika w Toruniu
Uniwersytet Warszawski

Streszczenie

Referat dotyczy estymatorów opartych na minimalizacji U -procesów z karą Lasso [2]. Metody te są stosowane w regresji liniowej, regresji porządkowej czy analizie przeżycia [1]. Otrzymane wyniki opisują asymptotyczne własności procedur w zgodności w selekcji cech oraz estymacji w przypadku, gdy liczba estymowanych parametrów jest ustalona (niezależna od licznosci próby).

Literatura

- Han, A.K. (1987). Non-parametric analysis of a generalized regression model. *Journal of Econometrics* 35, 303–316.
- Tibshirani, R. (1996). Regression shrinkage and selection via the lasso. *Journal of the Royal Statistical Society: Series B* 58, 267-288.