



2017년도 제2회 통계적 방법론 공개 강좌

과목 소개

고차원 회귀모형과 변수 선택의 이해 및 활용

변수의 개수(p)가 샘플의 개수(n)보다 많은 경우에는 전통적인 회귀분석 방법을 사용할 수가 없다. 이러한 경우 모수 공간에 제약(constraints)을 설정하여 모형을 적합하게 되는데, 제약의 설정은 일반적으로 벌점함수(penalty function)의 도입에 의해 이루어진다. 벌점함수의 도입은 벌점모수(penalty parameter)의 추정을 요구하고, 그 추정에 의하여 변수의 선택이 이루어지는 경우가 많이 있다. 본 강좌에서는 여러 가지 벌점함수들과 그 특징을 알아보고, 변수 선택 방법들을 설명한다. 또한, R 패키지를 이용하여 다양한 고차원 모형들을 실제 데이터 분석에 적용한 사례들을 살펴보고자 한다.

고 려 대 학 교 통 계 연 구 소

<http://stat.korea.ac.kr/>