

1.1.6 Least Angle Regression

肖麗穎

最小角度回帰 (LARS) は 高次元のデータの回帰アルゴリズムだ。

LARSの利点:

LARSは、

- 次元数は点の数より著しく大きい場合でも、数値的に効果的だ
- 計算上前進選択と同じ高速で、通常 of 最小二乗法と同じ複雑さだ。
- 完全な区分線形解経路を作り出す。(この解経路は交差検定または類似の試みでモデルを調整することに役立つ。)
- もし二つの変数は応答が等しい相関だったら、係数はほぼ同じ速度で増加する。そして、このアルゴリズムは直観の期待のように行う。
- 他の推定のために解答が出るように、修正されやすい。

- LARSの欠点
- LARSは残差の反復的な再装備に基づいているから、ノイズの影響に特に敏感であるようにしてる。