

*dr Konrad Furmańczyk*

*Wydział Zastosowań Informatyki i Matematyki SGGW*

## **Selekcja zmiennych w wysokowymiarowym modelu liniowym**

W referacie zostanie przedstawiona dwustopniowa procedura selekcji zmiennych w rzadkim wysokowymiarowym modelu liniowym, gdy liczba predyktorów  $p$  znacznie przewyższa liczbę obserwacji  $n$ . W pierwszym kroku wykonana zostanie procedura LASSO, a w drugim kroku procedura *stepdown* testowania wielu hipotez. Podamy wynik teoretyczny dotyczący zgodnego wyboru zmiennych oraz wyniki symulacyjne.