

Le chemin des solutions de l'estimateur SLOPE

Friday, June 9, 2023 2:00 PM (45 minutes)

L'estimateur SLOPE a la particularité d'avoir des composantes nulles (parcimonie) et des composantes égales en valeur absolue (appariement). Le nombre de groupes d'appariement dépend du taux de régularisation de cet estimateur. Avoir un petit nombre de groupes facilite l'interprétation de l'estimateur SLOPE. Ainsi, le taux de régularisation peut être choisi de façon à avoir un bon compromis entre un faible nombre de groupes d'appariement et un estimateur précis. Trouver un tel compromis nécessite de calculer l'estimateur SLOPE en fonction du taux de régularisation ; c'est le problème que nous allons aborder durant cette présentation.

Presenter: TARDIVEL, Patrick