

平成 27 年度

広島大学理学研究科 数学教室談話会

平成 28 年 1 月 26 日 (火) 午後 1 時
広島大学理学部 B 棟 7 階 B707 教室

柳原 宏和 氏 (広島大学 大学院理学研究科)

Consistent Information Criterion in Normal Multivariate Linear Regression Models even under High-Dimensionality

正規性を仮定した多変量線形回帰モデルにおける変数選択において、標本数のみを無限大とする大標本漸近理論に枠組みでは、一致性を持つ情報量規準は多く存在する。標本数と目的変数ベクトルの次元数をその比が一定となる条件の下で同時に無限大とする高次元漸近理論の枠組みでは、一致性を持つか持たないかは非心パラメータ行列の収束速度に依存する。残念ながら、現在提案されている規準量の中には、どのような非心パラメータ行列の下でも一致性を持つものはない。そこで本研究では、次元数が無限大か有限かにかかわらず、どのような非心パラメータ行列の下でも一致性を持つ新たな規準量を提案する。

同日午後 2 時より理学部 B 棟 7 階応接会議談話室 (B710) において講演者を囲んでのお茶会を開きます。お気軽にご参加ください。

問合せ先:

広島大学理学研究科数学教室談話会係

〒 739-8526 東広島市鏡山 1-3-1

電話: 082-424-7346 (西森 拓)

email: nishimor@hiroshima-u.ac.jp

最新の教室情報はホームページをご覧ください。

<http://www.math.sci.hiroshima-u.ac.jp/index-j.html>

※ 本セミナーは、5 研究科共同セミナーを兼ねています。