

外れ値があるデータにおける回帰モデリング

東京工業大学 川島 孝行

データを解析する際に、直面する問題の一つに外れ値の存在があげられる。通常の推定手法では、外れ値の影響を大きく受けてしまい、妥当な推定を行うことが困難となる。そこで、外れ値に強いロバストな推定手法を考えたい。特に、回帰問題における外れ値に対するロバストな推定手法に着目する。本発表では、まず、回帰問題に限らない、基本的な設定におけるロバストな推定手法の説明から始め、回帰問題特有の外れ値の振る舞い・既存のロバストな回帰手法などの紹介を行い、最後に最近の自身の研究についての解説を行う予定である。