#Compute correlation matrix after nonparanormal transformation CorData (- huge.npn(data, npn.func='skeptic')

The huge Package for High-dimensional Undirected Graph Estimation in R

고차원 무방향 그래프 추정을 위한 패키지

GGM은 여러 노드 간의 고유 의존성을 연구하기 위해 사용되고 가우스성 가정은 많은 응용분야에서 제한적이다 -> 그래서 사용하는 것이 비모수 그래픽 모델

비모수 그래픽 모델은 연속 변수에 대한 반모수 일반화

스피어만과 켄달을 포함한 nonparametric rank-based 통계를 사용하여 알려지지 않은 상관 행렬을 직접 추정하는 것 -> 이후 lasso에 연결하여 최종 추정치 얻음

ALL





















