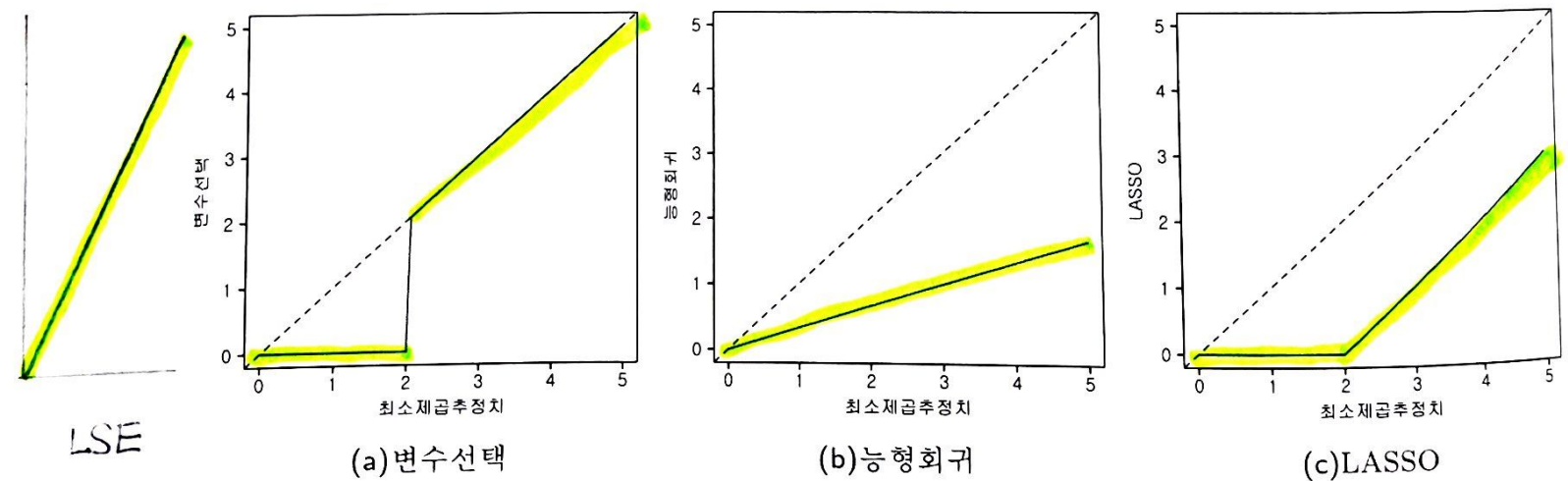


(그림 7.3) 능형 추정치(좌)와 LASSO 추정치(우)의 기하학적 의미

- (1) 변수선택 : $\hat{\beta}_{S,j} = \hat{\beta}_j I(|\hat{\beta}_j| > \lambda)$
- (2) 능형회귀 : $\hat{\beta}_{R,j} = \hat{\beta}_j / (1 + \lambda)$
- (3) LASSO : $\hat{\beta}_{L,j} = \text{sign}(\beta_j)(|\beta_j| - \lambda)_+$



(그림 7.4) 최소제곱추정치와의 비교((a) 변수선택, (b) 능형회귀, (c) LASSO)