

Elastic Net

Se trata da combinação das regularizações L1 e L2.

$$CUSTO = \sum_{i=1}^m (\text{reg}_i - y_i)^2 + C \sum_{i=1}^m |m_i| + (1-C) \sum_{i=1}^m m_i^2$$

A constante C vai variar entre 0 e 1. Por exemplo, se $C = 0.5$, significa que será usado 50% de peso para a regularização L1 e 50% de L2, ou se definirmos $C = 0.9$, a Regularização L1 terá um peso de 90% e L2 de 10%, pois $1 - 0.9 = 0.1$.

$$= \sum_{i=1}^m (\text{reg}_i - y_i)^2 + \underbrace{C \sum_{i=1}^m |m_i|}_{\substack{L1 \\ \text{LASSO}}} + \underbrace{(1-C) \sum_{i=1}^m m_i^2}_{\substack{L2 \\ \text{RIDGE}}}$$

$0 \leq C \leq 1$	0,5	0,5
	0,9	0,1
	0,1	0,9