

Домашнее задание по материалу 3-го семинара.

ММП, весна 2013

8 марта

1. Попробуйте разобраться, в чем отличаются алгоритмы GBM и AnyBoost на этапе выбора очередной базовой функции h_t ?
2. Рассмотрим задачу регрессии $\mathbb{Y} = \mathbb{R}$ с квадратичной функцией потерь $L(y, F(x)) = (y, F(x))^2$. Убедитесь, что на каждом шаге алгоритм GBM выбирает базовую функцию h_t , ответы которой на объектах обучающей выборки наиболее близки к остаткам $y_i - F_{t-1}(x_i)$ текущей композиции в смысле МНК.