

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.