

Задание 1 по теме “Линейная регрессия.”

1.1 Многомерная линейная регрессия. Пусть имеется набор данных $(x_\alpha^{(i)}, y^{(i)})$, $i = 1 \dots m$, $\alpha = 1 \dots k$. Здесь индекс (i) нумерует события в наборе, а индекс α – переменные. Линейная регрессия – аппроксимация данных функцией первого порядка $y = b_0 + \sum_{\alpha=1}^m b_\alpha x_\alpha$.

- i) Используя квадратичную функцию стоимости и считая ошибки измерения $y^{(i)}$ одинаковыми и равными σ , получить выражения для коэффициентов линейной регрессии b_0, b_α .
- ii) Повторить вывод, считая ошибки измерения $y^{(i)}$ разными и равными $\sigma^{(i)}$.

1.2 Линейная аппроксимация функций. Для перечисленных ниже функций

- i) $\sin(x)$, $x \in [0, \pi/2]$
- ii) $\log(1+x)$, $x \in [0, 1]$
- iii) $|x|$, $x \in [-1, 1]$
- iv) ступенька $\theta(x-1)$, $x \in [0, 2]$
- v) $\exp(-1/x^2)$, $x \in [0, 3]$

выполнить следующие упражнения:

- a) Сгенерировать набор N равномерно распределенных случайных значений x и вычислить для них значение исследуемой функции. Этот набор назовем тренировочным. Аналогично построить второй (тестовый) набор такого же объема.
- б) Используя тренировочный набор, построить линейную регрессию.
- в) Получить аналитически ответ для линейной регрессии в пределе $N \rightarrow \infty$.
- г) Используя тестовый набор, построить долю объясненной дисперсии как функцию N .

1.3 Упрощенная классификация гамма-всплесков. В этом задании начнем рассматривать задачу классификации гамма-всплесков, стартуя с предельно упрощенной модели. Будем считать, что для гамма-всплеска известна лишь длительность, причем короткие и длинные гамма-всплески равномерно распределены по длительности.

- a) Смоделировать тренировочный набор $3N$ коротких гамма-всплесков с длительностью $\tau \in (0, 2)$ секунд и $7N$ длинных гамма-всплесков с длительностью $\tau \in (2, 1000)$ секунд. Аналогично построить тестовый набор.
- б) Считаем, что искомая функция равна 0 для коротких гамма-всплесков и 1 для длинных гамма-всплесков.
- в) Построить классификатор гамма-всплесков, основанный на методе линейной регрессии.
- г) Построить кривую обучения.