
Разработка эффективных методов построения ансамблевых регрессионных линейных моделей, основанных на минимизации ошибки

A Preprint

Суржанский Александр
Московский государственный университет
имени М. В. Ломоносова
`alexandr.surzhanskiy@yandex.ru`

5 декабря 2024 г.

Abstract

В данной работе рассматриваются характерные черты и применение выпуклых корректирующих процедур (ВКП) в отношении множеств прогностических функций - предикторов. Обнаружено, что задача снижения обобщенной ошибки этих процедур может быть преобразована в задачу квадратичного программирования. Проанализированы условия, при которых невозможно сократить число предикторов без ухудшения точности оптимизированной ВКП. Эксперименты, проведенные на наборах одномерных линейных регрессий, продемонстрировали, что применение оптимизации ВКП может служить мощным методом для отбора и улучшения качеств наборов регрессоров.