

Стохастический градиентный спуск и бета-регрессия

Олейник Михаил, группа 24.М22-мм

12 декабря 2024 г.

Весь код с комментариями и результатами можно найти в репозитории.

1 Задача линейной регрессии

Решение задачи линейной регрессии заключается в нахождении коэффициентов $\bar{\beta}$ линейной комбинации для случайной величины $\xi \sim N(\mu_\xi, \sigma)$ и случайного вектора $\bar{\eta} \sim \mathbf{N}(\bar{\mu}_\eta, \Sigma)$:

$$\xi = \bar{\eta}^T \bar{\beta} + \varepsilon,$$