

Задача 1. Ridge Regression

Ridge regression – модель, идентичная обычной линейной регрессии, но с добавленной L_2 регуляризацией. Обозначим $X : n \times m$ матрицу признаков описаний объектов, $Y : n$ – вектор значений целевой переменной, \mathbf{w} – вектор весов (параметров модели), λ – параметр регуляризации. Покажите, что оптимальное \mathbf{w} выражается как

$$\mathbf{w} = (XX^T + \lambda I)^{-1}XY$$

Задача 2. Softmax классификатор

Для того чтобы распространить логистическую регрессию на случай задачи классификации с m классами, смоделируем вероятность принадлежности к $k \in 1 \dots m$ классу с помощью softmax-функции

$$p(y_k|x) = \frac{\exp(a_k)}{\sum_{j=1}^m \exp(a_j)}, \quad a_k = \mathbf{w}^T \mathbf{x}$$

Для такой модели выпишите функцию правдоподобия и выражение для ее градиента.

Задача 3. SVM

Сопоставьте формулировки задач SVM (слева) и полученные разделяющие поверхности (справа). Аргументируйте свой ответ.

1.
$$\min \frac{1}{2} \mathbf{w} \cdot \mathbf{w} + C \sum_{i=1}^n \xi_i$$

s.t. $\forall i = 1, \dots, n$:
 $\xi_i \geq 0$
 $(\mathbf{w} \cdot \mathbf{x}_i + b)y_i - (1 - \xi_i) \geq 0$
and $C = 0.1$.

2.
$$\min \frac{1}{2} \mathbf{w} \cdot \mathbf{w} + C \sum_{i=1}^n \xi_i$$

s.t. $\forall i = 1, \dots, n$:
 $\xi_i \geq 0$
 $(\mathbf{w} \cdot \mathbf{x}_i + b)y_i - (1 - \xi_i) \geq 0$
and $C = 1$.

3.
$$\max \sum_{i=1}^n \alpha_i - \frac{1}{2} \sum_{i,j} \alpha_i \alpha_j y_i y_j K(\mathbf{x}_i, \mathbf{x}_j)$$

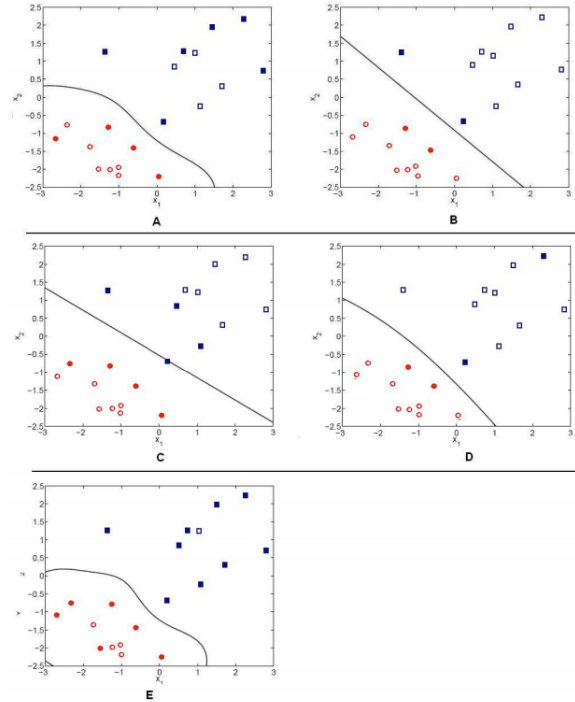
s.t. $\sum_{i=1}^n \alpha_i y_i = 0$;
 $\alpha_i \geq 0, \forall i = 1, \dots, n$;
where $\mathbf{K}(\mathbf{u}, \mathbf{v}) = \mathbf{u} \cdot \mathbf{v} + (\mathbf{u} \cdot \mathbf{v})^2$.

4.
$$\max \sum_{i=1}^n \alpha_i - \frac{1}{2} \sum_{i,j} \alpha_i \alpha_j y_i y_j K(\mathbf{x}_i, \mathbf{x}_j)$$

s.t. $\sum_{i=1}^n \alpha_i y_i = 0$;
 $\alpha_i \geq 0, \forall i = 1, \dots, n$;
where $\mathbf{K}(\mathbf{u}, \mathbf{v}) = \exp(-\frac{\|\mathbf{u} - \mathbf{v}\|^2}{2})$.

5.
$$\max \sum_{i=1}^n \alpha_i - \frac{1}{2} \sum_{i,j} \alpha_i \alpha_j y_i y_j K(\mathbf{x}_i, \mathbf{x}_j)$$

s.t. $\sum_{i=1}^n \alpha_i y_i = 0$;
 $\alpha_i \geq 0, \forall i = 1, \dots, n$;
where $\mathbf{K}(\mathbf{u}, \mathbf{v}) = \exp(-\|\mathbf{u} - \mathbf{v}\|^2)$.



Задача 4. Naive Bayes

С помощью алгоритма Naive Bayes предскажите значение целевой переменной *buy_computer* для объекта со следующими значениями признаков:

age <= 30 & income = medium & student = yes & credit-rating = fair

Для обучения модели используйте данные из таблицы и сглаживание Лапласа.

<i>RID</i>	<i>age</i>	<i>income</i>	<i>student</i>	<i>credit_rating</i>	<i>Class: buys_computer</i>
1	<=30	high	no	fair	no
2	<=30	high	no	excellent	no
3	31 ... 40	high	no	fair	yes
4	>40	medium	no	fair	yes
5	>40	low	yes	fair	yes
6	>40	low	yes	excellent	no
7	31 ... 40	low	yes	excellent	yes
8	<=30	medium	no	fair	no
9	<=30	low	yes	fair	yes
10	>40	medium	yes	fair	yes
11	<=30	medium	yes	excellent	yes
12	31 ... 40	medium	no	excellent	yes
13	31 ... 40	high	yes	fair	yes
14	>40	medium	no	excellent	no

Задача 5. Решающие деревья

С помощью алгоритма CART постройте первые два уровня дерева решений на основании представленных данных. Используйте gini impurity.

```
medium skiing design single twenties no -> highRisk
high golf trading married forties yes -> lowRisk
low speedway transport married thirties yes -> medRisk
medium football banking single thirties yes -> lowRisk
high flying media married fifties yes -> highRisk
low football security single twenties no -> medRisk
medium golf media single thirties yes -> medRisk
medium golf transport married forties yes -> lowRisk
high skiing banking single thirties yes -> highRisk
low golf unemployed married forties yes -> highRisk
```