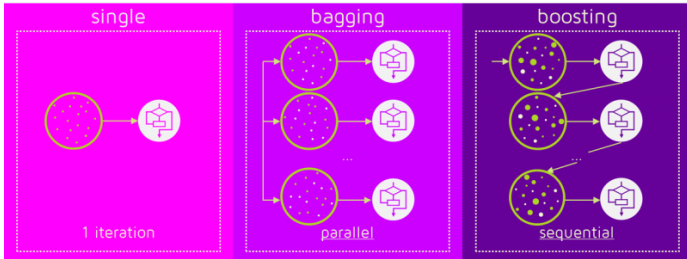


Machine Learning, méthodes et solutions

Gradient boosted trees

Introduction

Arbres qui s'améliorent successivement.



quantdare.com/what-is-the-difference-between-bagging-and-boosting/

Algorithme grossier

1. partir d'un arbre grossier
2. entraîner un nouvel arbre sur les résiduels du premier
3. concaténer le nouvel arbre au premier
4. goto 2.

- séquence d'arbres qui s'entraînent à corriger les erreurs de l'arbre d'avant
- modélisation de la correction de l'erreur par un pas de descente de gradient pour plus de flexibilité.