



Семинар “Индустриальная математика”

Пятница, 30 октября 2020, 15:30 (Moscow time, GMT+3)

Zoom ID: 862-2331-4466, password: ind

Быстрое получение траекторий гауссовского процесса



[Петр Мостовский](#) (СПбГУ)

Основным препятствием в использовании основанных на гауссовских процессах моделей в машинном обучении до недавнего времени являлась высокая вычислительная сложность таких моделей. Кубическая сложность вычислений возникает как при обучении модели (в зависимости от размера тренировочной выборки), так и при получении траекторий гауссовского процесса (в зависимости от размера тестовой выборки). В последние годы в области машинного обучения разработаны методы, которые позволяют снижать сложность вычислений при обучении. В то же время в геостатистике известен способ быстрого получения траекторий гауссовского процесса. В докладе я расскажу, как совместить эти подходы для эффективного получения траекторий процесса в режиме большого количества тренировочных данных, и зачем это нужно для практических приложений.

Приглашаются все желающие!