

超参数优化

有了优秀的模型，就有了优化超参数以获得最佳得分模型的难题。那么，什么是超参数优化呢？假设您的机器学习项目有一个简单的流程。有一个数据集，你直接应用一个模型，然后得到结果。模型在这里的参数被称为超参数，即控制模型训练/拟合过程的参数。如果我们用 SGD 训练线性回归，模型的参数是斜率和偏差，超参数是学习率。你会发现我在本章和本书中交替使用这些术语。假设模型中有三个参数 a、b、c，所有这些参数都可以是 1 到 10 之间的整数。这些参数的 "正确" 组合将为您提供最佳结果。因此，这就有点像一个装有三拨密码锁的手提箱。不过，三拨密码锁只有一个正确答案。而模型有很多正确答案。那么，如何找到最佳参数呢？一种方法是对所有组合进行评估，看哪种组合能提高指标。让我们看看如何做到这一点。

```
best_accuracy = 0
best_parameters = {"a": 0, "b": 0, "c": 0}
for a in range(1, 11):
    for b in range(1, 11):
        for c in range(1, 11):
            model = MODEL(a, b, c)
            model.fit(training_data)
            preds = model.predict(validation_data)
            accuracy = metrics.accuracy_score(targets, preds)
            if accuracy > best_accuracy:
                best_accuracy = accuracy
                best_parameters["a"] = a
                best_parameters["b"] = b
                best_parameters["c"] = c
```

在上述代码中，我们从 1 到 10 对所有参数进行了拟合。因此，我们总共要对模型进行 1000 次（10×10×10）拟合。这可能会很昂贵，因为模型的训练需要很长时间。不过，在这种情况下应该没问题，但在现实世界中，并不是只有三个参数，每个参数也不是只有十个值。大多数模型参数都是实数，不同参数的组合可以是无限的。

让我们看看 scikit-learn 的随机森林模型。

```
RandomForestClassifier(
    n_estimators=100,
    criterion='gini',
    max_depth=None,
    min_samples_split=2,
    min_samples_leaf=1,
    min_weight_fraction_leaf=0.0,
    max_features='auto',
```

```

max_leaf_nodes=None,
min_impurity_decrease=0.0,
min_impurity_split=None,
bootstrap=True,
oob_score=False,
n_jobs=None,
random_state=None,
verbose=0,
warm_start=False,
class_weight=None,
ccp_alpha=0.0,
max_samples=None,
)

```

有 19 个参数，而所有这些参数的所有组合，以及它们可以承担的所有值，都将是无穷无尽的。通常情况下，我们没有足够的资源和时间来做这件事。因此，我们指定了一个参数网格。在这个网络上寻找最佳参数组合的搜索称为网格搜索。我们可以说，`n_estimators` 可以是 100、200、250、300、400、500；`max_depth` 可以是 1、2、5、7、11、15；`criterion` 可以是 `gini` 或 `entropy`。这些参数看起来并不多，但如果数据集过大，计算起来会耗费大量时间。我们可以像之前一样创建三个 `for` 循环，并在验证集上计算得分，这样就能实现网格搜索。还必须注意的是，如果要进行 `k` 折交叉验证，则需要更多的循环，这意味着需要更多的时间来找到完美的参数。因此，网格搜索并不流行。让我们以根据[手机配置预测手机价格范围](#)数据集为例，看看它是如何实现的。

battery_power	blue	clock_speed	dual_sim	fc	four_g	int_memory	m_dep	price_range
842	0	2.2	0	1	0	7	0.6	1
1021	1	0.5	1	0	1	53	0.7	2
563	1	0.5	1	2	1	41	0.9	2
615	1	2.5	0	0	0	10	0.8	2
1821	1	1.2	0	13	1	44	0.6	1
...
794	1	0.5	1	0	1	2	0.8	0
1965	1	2.6	1	0	0	39	0.2	2

图1：手机配置预测手机价格范围数据集展示

训练集中只有 2000 个样本。我们可以轻松地使用分层 `kfold` 和准确率作为评估指标。我们将使用具有上述参数范围的随机森林模型，并在下面的示例中了解如何进行网格搜索。

```
# rf_grid_search.py
```

```

import numpy as np
import pandas as pd
from sklearn import ensemble
from sklearn import metrics
from sklearn import model_selection
if __name__ == "__main__":
    df = pd.read_csv("../input/mobile_train.csv")
    X = df.drop("price_range", axis=1).values
    y = df.price_range.values
    classifier = ensemble.RandomForestClassifier(n_jobs=-1)
    param_grid = {
        "n_estimators": [100, 200, 250, 300, 400, 500],
        "max_depth": [1, 2, 5, 7, 11, 15],
        "criterion": ["gini", "entropy"]
    }
    model = model_selection.GridSearchCV(
        estimator=classifier,
        param_grid=param_grid,
        scoring="accuracy",
        verbose=10,
        n_jobs=1,
        cv=5
    )
    model.fit(X, y)
    print(f"Best score: {model.best_score_}")
    print("Best parameters set:")
    best_parameters = model.best_estimator_.get_params()
    for param_name in sorted(param_grid.keys()):
        print(f"\t{param_name}: {best_parameters[param_name]}")

```

这里打印了很多内容，让我们看看最后几行。

```

[CV] criterion=entropy, max_depth=15, n_estimators=500, score=0.895,
total= 1.0s
[CV] criterion=entropy, max_depth=15, n_estimators=500 .....
[CV] criterion=entropy, max_depth=15, n_estimators=500, score=0.890,
total= 1.1s
[CV] criterion=entropy, max_depth=15, n_estimators=500 .....
[CV] criterion=entropy, max_depth=15, n_estimators=500, score=0.910,
total= 1.1s
[CV] criterion=entropy, max_depth=15, n_estimators=500 .....
[CV] criterion=entropy, max_depth=15, n_estimators=500, score=0.880,
total= 1.1s
[CV] criterion=entropy, max_depth=15, n_estimators=500 .....
[CV] criterion=entropy, max_depth=15, n_estimators=500, score=0.870,

```

```
total= 1.1s
[Parallel(n_jobs=1)]: Done 360 out of 360 | elapsed: 3.7min finished
Best score: 0.889
Best parameters set:
  criterion: 'entropy'
  max_depth: 15
  n_estimators: 500
```

最后，我们可以看到，5折交叉检验最佳得分是 0.889，我们的网格搜索得到了最佳参数。我们可以使用的下一个最佳方法是[随机搜索](#)。在随机搜索中，我们随机选择一个参数组合，然后计算交叉验证得分。这里消耗的时间比网格搜索少，因为我们不对所有不同的参数组合进行评估。我们选择要对模型进行多少次评估，这就决定了搜索所需的时间。代码与上面的差别不大。除 GridSearchCV 外，我们使用 RandomizedSearchCV。

```
if __name__ == "__main__":
    classifier = ensemble.RandomForestClassifier(n_jobs=-1)
    param_grid = {
        "n_estimators": np.arange(100, 1500, 100),
        "max_depth": np.arange(1, 31),
        "criterion": ["gini", "entropy"]
    }

    model = model_selection.RandomizedSearchCV(
        estimator=classifier,
        param_distributions=param_grid,
        n_iter=20,
        scoring="accuracy",
        verbose=10,
        n_jobs=1,
        cv=5
    )
    model.fit(X, y)
    print(f"Best score: {model.best_score_}")
    print("Best parameters set:")
    best_parameters = model.best_estimator_.get_params()
    for param_name in sorted(param_grid.keys()):
        print(f"\t{param_name}: {best_parameters[param_name]}")
```

我们更改了随机搜索的参数网格，结果似乎有了些许改进。

```
Best score: 0.8905
Best parameters set:
  criterion: entropy
  max_depth: 25
  n_estimators: 300
```

如果迭代次数较少，随机搜索比网格搜索更快。使用这两种方法，你可以为各种模型找到最优参数，只要它们有拟合和预测功能，这也是 scikit-learn 的标准。有时，你可能想使用管道。例如，假设我们正在处理一个多类分类问题。在这个问题中，训练数据由两列文本组成，你需要建立一个模型来预测类别。让我们假设你选择的管道是首先以半监督的方式应用 tf-idf，然后使用 SVD 和 SVM 分类器。现在的问题是，我们必须选择 SVD 的成分，还需要调整 SVM 的参数。下面的代码段展示了如何做到这一点。

```
import numpy as np
import pandas as pd
from sklearn import metrics
from sklearn import model_selection
from sklearn import pipeline
from sklearn.decomposition import TruncatedSVD
from sklearn.feature_extraction.text import TfidfVectorizer
from sklearn.preprocessing import StandardScaler
from sklearn.svm import SVC
def quadratic_weighted_kappa(y_true, y_pred):
    return metrics.cohen_kappa_score(
        y_true,
        y_pred,
        weights="quadratic"
    )
if __name__ == '__main__':
    train = pd.read_csv('../input/train.csv')
    idx = test.id.values.astype(int)
    train = train.drop('id', axis=1)
    test = test.drop('id', axis=1)
    y = train.relevance.values
    traindata = list(train.apply(lambda x: '%s %s' % (x['text1'],
x['text2']),axis=1))
    testdata = list(test.apply(lambda x: '%s %s' % (x['text1'],
x['text2']),axis=1))
    tfv = TfidfVectorizer(
        min_df=3,
        max_features=None,
        strip_accents='unicode',
        analyzer='word',
        token_pattern=r'\w{1,}',
```

```

        ngram_range=(1, 3),
        use_idf=1,
        smooth_idf=1,
        sublinear_tf=1,
        stop_words='english'
    )

    tfv.fit(traindata)
    X = tfv.transform(traindata)
    X_test = tfv.transform(testdata)
    svd = TruncatedSVD()
    scl = StandardScaler()
    svm_model = SVC()

    clf = pipeline.Pipeline(
        [
            ('svd', svd),
            ('scl', scl),
            ('svm', svm_model)
        ]
    )

    param_grid = {
        'svd__n_components' : [200, 300],
        'svm__C': [10, 12]
    }

    kappa_scorer = metrics.make_scorer(
        quadratic_weighted_kappa,
        greater_is_better=True
    )

    model = model_selection.GridSearchCV(
        estimator=clf,
        param_grid=param_grid,
        scoring=kappa_scorer,
        verbose=10,
        n_jobs=-1,
        refit=True,
        cv=5
    )

    model.fit(X, y)
    print("Best score: %0.3f" % model.best_score_)
    print("Best parameters set:")
    best_parameters = model.best_estimator_.get_params()

```

```

for param_name in sorted(param_grid.keys()):
    print("\t%s: %r" % (param_name, best_parameters[param_name]))
best_model = model.best_estimator_
best_model.fit(X, y)
preds = best_model.predict(...)

```

这里显示的管道包括 SVD（奇异值分解）、标准缩放和 SVM（支持向量机）模型。请注意，由于没有训练数据，您无法按原样运行上述代码。当我们进入高级超参数优化技术时，我们可以使用不同类型的**最小化算法**来研究函数的最小化。这可以通过使用多种最小化函数来实现，如下坡单纯形算法、内尔德-梅德优化算法、使用贝叶斯技术和高斯过程寻找最优参数或使用遗传算法。我将在 "集合与堆叠（ensembling and stacking）" 一章中详细介绍下坡单纯形算法和 Nelder-Mead 算法的应用。首先，让我们看看高斯过程如何用于超参数优化。这类算法需要一个可以优化的函数。大多数情况下，都是最小化这个函数，就像我们最小化损失一样。

因此，比方说，你想找到最佳参数以获得最佳准确度，显然，准确度越高越好。现在，我们不能最小化精确度，但我们可以将精确度乘以-1。这样，我们是在最小化精确度的负值，但事实上，我们是在最大化精确度。在高斯过程中使用贝叶斯优化，可以使用 scikit-optimize (skopt) 库中的 gp_minimize 函数。让我们看看如何使用该函数调整随机森林模型的参数。

```

# rf_gp_minimize.py
import numpy as np
import pandas as pd
from functools import partial
from sklearn import ensemble
from sklearn import metrics
from sklearn import model_selection
from skopt import gp_minimize
from skopt import space

def optimize(params, param_names, x, y):
    params = dict(zip(param_names, params))
    model = ensemble.RandomForestClassifier(**params)
    kf = model_selection.StratifiedKFold(n_splits=5)
    accuracies = []
    for idx in kf.split(X=x, y=y):
        train_idx, test_idx = idx[0], idx[1]

        xtrain = x[train_idx]
        ytrain = y[train_idx]

        xtest = x[test_idx]
        ytest = y[test_idx]

        model.fit(xtrain, ytrain)

```

```

        preds = model.predict(xtest)

        fold_accuracy = metrics.accuracy_score(ytest, preds)
        accuracies.append(fold_accuracy)
    return -1 * np.mean(accuracies)

if __name__ == "__main__":
    df = pd.read_csv("../input/mobile_train.csv")
    X = df.drop("price_range", axis=1).values
    y = df.price_range.values
    param_space = [
        space.Integer(3, 15, name="max_depth"),
        space.Integer(100, 1500, name="n_estimators"),
        space.Categorical(["gini", "entropy"], name="criterion"),
        space.Real(0.01, 1, prior="uniform", name="max_features")
    ]

    param_names = [
        "max_depth",
        "n_estimators",
        "criterion",
        "max_features"
    ]

    optimization_function = partial(
        optimize,
        param_names=param_names,
        x=X,
        y=y
    )

    result = gp_minimize(
        optimization_function,
        dimensions=param_space,
        n_calls=15,
        n_random_starts=10,
        verbose=10
    )

    best_params = dict(
        zip(
            param_names,
            result.x
        )
    )
    print(best_params)

```


这同样会产生大量输出，最后一部分如下所示。

```
Iteration No: 14 started. Searching for the next optimal point.  
Iteration No: 14 ended. Search finished for the next optimal point.  
Time taken: 4.7793  
Function value obtained: -0.9075  
Current minimum: -0.9075  
Iteration No: 15 started. Searching for the next optimal point.  
Iteration No: 15 ended. Search finished for the next optimal point.  
Time taken: 49.4186  
Function value obtained: -0.9075  
Current minimum: -0.9075  
{'max_depth': 12, 'n_estimators': 100, 'criterion': 'entropy',  
'max_features': 1.0}
```

看来我们已经成功突破了 0.90 的准确率。这真是太神奇了！
我们还可以通过以下代码段查看（绘制）我们是如何实现收敛的。

```
from skopt.plots import plot_convergence  
plot_convergence(result)
```

收敛图如图 2 所示。

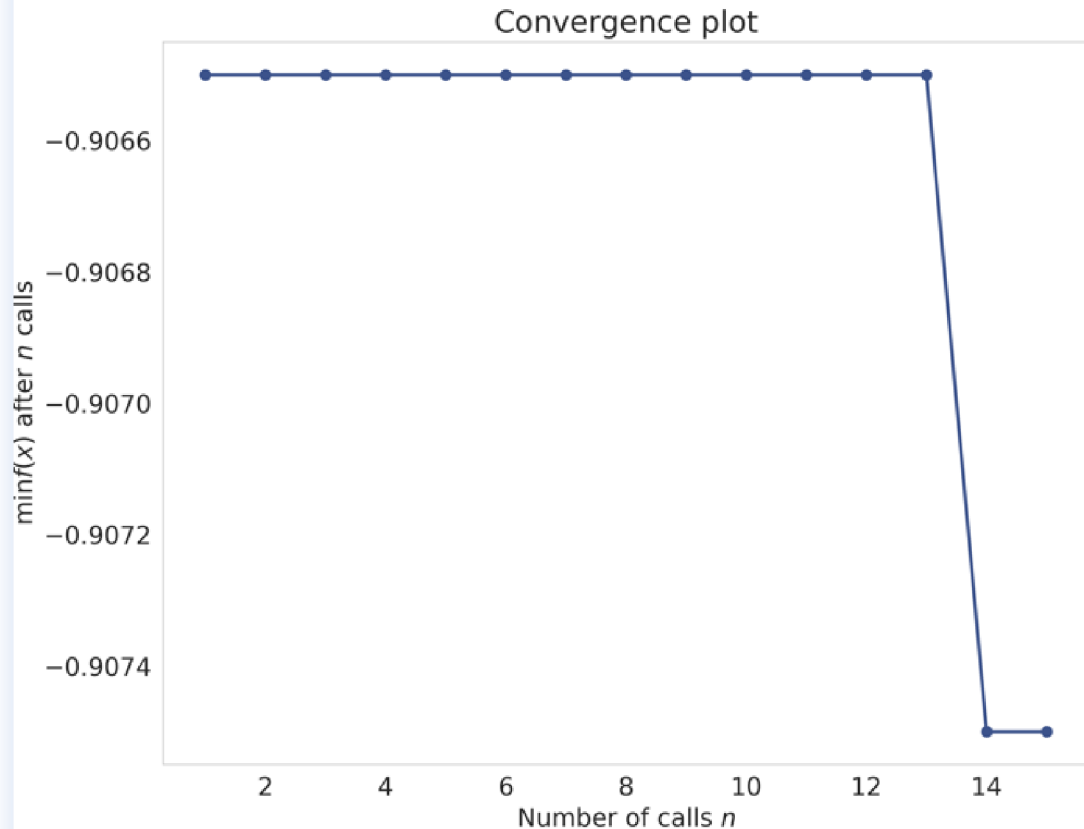


图 2：随机森林参数优化的收敛图

Scikit- optimize 就是这样一个库。hyperopt 使用树状结构帕岑估计器（TPE）来找到最优参数。请看下面的代码片段，我在使用 hyperopt 时对之前的代码做了最小的改动。

```
import numpy as np
import pandas as pd
from functools import partial
from sklearn import ensemble
from sklearn import metrics
from sklearn import model_selection
from hyperopt import hp, fmin, tpe, Trials
from hyperopt.pyll.base import scope
def optimize(params, x, y):
    model = ensemble.RandomForestClassifier(**params)
    kf = model_selection.StratifiedKFold(n_splits=5)
    ...
    return -1 * np.mean(accuracies)

if __name__ == "__main__":
    df = pd.read_csv("../input/mobile_train.csv")
```

```

X = df.drop("price_range", axis=1).values
y = df.price_range.values

param_space = {
    "max_depth": scope.int(hp.quniform("max_depth", 1, 15, 1)),
    "n_estimators": scope.int(
        hp.quniform("n_estimators", 100, 1500, 1)
    ),
    "criterion": hp.choice("criterion", ["gini", "entropy"]),
    "max_features": hp.uniform("max_features", 0, 1)
}

optimization_function = partial(
    optimize,
    x=X,
    y=y
)

trials = Trials()
hopt = fmin(
    fn=optimization_function,
    space=param_space,
    algo=tpe.suggest,
    max_evals=15,
    trials=trials
)
print(hopt)

```

正如你所看到的，这与之前的代码并无太大区别。你必须以不同的格式定义参数空间，还需要改变实际优化部分，用 `hyperopt` 代替 `gp_minimize`。结果相当不错！

```

> python rf_hyperopt.py
100%|████████████████████| 15/15 [04:38<00:00, 18.57s/trial, best loss: -
0.9095000000000001]
{'criterion': 1, 'max_depth': 11.0, 'max_features': 0.821163568049807,
'n_estimators': 806.0}

```

我们得到了比以前更好的准确度和一组可以使用的参数。请注意，最终结果中的标准是1。这意味着选择了1，即熵。上述调整超参数的方法是最常见的，几乎适用于所有模型：线性回归、逻辑回归、基于树的方法、梯度提升模型（如 `xgboost`、`lightgbm`），甚至神经网络！

虽然这些方法已经存在，但学习时必须从手动调整超参数开始，即手工调整。手动调整可以帮助你学习基础知识，例如，在梯度提升中，当你增加深度时，你应该降低学习率。如果使用自动工具，就无法学习到这一点。请参考下表，了解应如何调整。RS* 表示随机搜索应该更好。

一旦你能更好地手动调整参数，你甚至可能不需要任何自动超参数调整。创建大型模型或引入大量特征时，也容易造成训练数据的过度拟合。为避免过度拟合，需要在训练数据特征中引入噪声或对代价函数进行惩罚。这种惩罚称为**正则化**，有助于泛化模型。在线性模型中，最常见的正则化类型是 L1 和 L2。L1 也称为 Lasso 回归，L2 称为 Ridge 回归。说到神经网络，我们会使用 dropout、添加增强、噪声等方法对模型进行正则化。利用超参数优化，还可以找到正确的惩罚方法。

Model	Optimize	Range of values
Linear Regression	- fit_intercept - normalize	- True/False - True/False
Ridge	- alpha - fit_intercept - normalize	- 0.01, 0.1, 1.0, 10, 100 - True/False - True/False
k-neighbors	- n_neighbors - p	- 2, 4, 8, 16, ... - 2, 3, ...
SVM	- C - gamma - class_weight	- 0.001, 0.01, ..., 10, 100, 1000 - 'auto', RS* - 'balanced', None
Logistic Regression	- Penalty - C	- L1 or L2 - 0.001, 0.01, ..., 10, ..., 100
Lasso	- Alpha - Normalize	- 0.1, 1.0, 10 - True/False
Random Forest	- n_estimators - max_depth - min_samples_split - min_samples_leaf - max features	- 120, 300, 500, 800, 1200 - 5, 8, 15, 25, 30, None - 1, 2, 5, 10, 15, 100 - log2, sqrt, None
XGBoost	- eta - gamma - max_depth - min_child_weight - subsample - colsample_bytree - lambda - alpha	- 0.01, 0.015, 0.025, 0.05, 0.1 - 0.05, 0.1, 0.3, 0.5, 0.7, 0.9, 1.0 - 3, 5, 7, 9, 12, 15, 17, 25 - 1, 3, 5, 7 - 0.6, 0.7, 0.8, 0.9, 1.0 - 0.6, 0.7, 0.8, 0.9, 1.0 - 0.01, 0.1, 1.0, RS - 0, 0.1, 0.5, 1.0, RS