

Linear Classification 02

Chen Gong

30 October 2019

本节的主要内容是描述两类硬分类模型，也就是感知机模型和线性判别模型 (Fisher 判别模型) 的算法原理和推导过程。

1 感知机模型

感知机模型是一类错误驱动模型，它的中心思想也就是“错误驱动”。什么意思呢？也就是哪些数据点分类错误了，那么我们就进行调整权值系数 w ，直到分类正确为止。

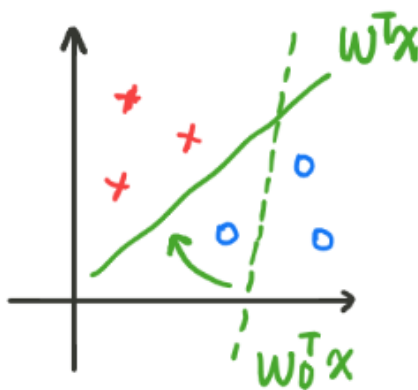


图 1: 感知机概念模型图

感知机可以做如下的描述：

$$f(x) = \text{sign}\{w^T x\} \quad x \in \mathbb{R}^p \quad w \in \mathbb{R}^p \quad (1)$$

$$\text{sign}(a) = \begin{cases} +1 & a \geq 0 \\ -1 & a < 0 \end{cases} \quad (2)$$

其中 D : { 被错误分类的样本 }，样本集为： $\{(x_i, y_i)\}_{i=1}^N$ 。

1.1 感知机模型的迭代过程

我们将损失函数定义为：

$$\mathcal{L}(w) = \sum_{i=1}^N I \{y_i w^T x_i < 0\} \quad (3)$$

而其中 $y_i w^T x_i < 0$ 就代表分类错误的类，为什么这么理解呢？因为：

$$\begin{cases} w^T x_i \geq 0 & y_i = +1 \\ w^T x_i < 0 & y_i = -1 \end{cases} \quad (4)$$

那么当分类正确时，必然有 $w^T x_i y_i > 0$ 。只有当错误分类的时候，才会出现 $w^T x_i y_i < 0$ 的情况。而在上述的函数中， I 干了一个什么事，那就是将函数的值离散化，令 \mathcal{L} 的值等于错误分类的点的个数，也就是这样一个映射 $I \mapsto 0, 1$ 。加这个函数的目的是得到损失函数的值，和普通的梯度下降法的过程一样。显然这不是一个连续的函数，无法求得其梯度来进行迭代更新。那么，我们需要想的办法是将离散的梯度连续。那么，我们将损失函数改写为：

$$\mathcal{L}(w) = \sum_{x_i \in D} -y_i w^T x_i \quad (5)$$

那么，梯度可以表示为：

$$\nabla_w \mathcal{L} = - \sum_{x_i \in D} y_i x_i \quad (6)$$

很显然，有关于 w 的迭代公式，可以表示为：

$$w^{(t+1)} \longleftrightarrow w^{(t)} - \lambda \nabla_w \mathcal{L} \quad (7)$$

代入可得，权值参数 w 的更新过程为：

$$w^{(t+1)} \longleftrightarrow w^{(t)} + \lambda \sum_{x_i \in D} y_i x_i \quad (8)$$

那么，通过上述的推导，我们就得到了感知机中 w 的更新过程。那么，感知机算法的推导过程就已经完成了。