课时内容

第5章 智能搜索技术



◆ 基本粒子群优化算法

* 粒子速度和位置的更新

假设在D维搜索空间中,有m个粒子;

其中第i个粒子的位置为矢量 $\vec{x}_i = (x_{i1}, x_{i2}, \dots, x_{iD})$

其飞翔速度也是一个矢量,记为 $\vec{v}_i = (v_{i1}, v_{i2}, \cdots, v_{iD})$

第i个粒子搜索到的最优位置为 $\vec{p}_i = (p_{i1}, p_{i2}, \cdots, p_{iD})$

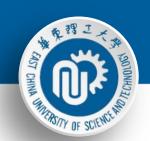
整个粒子群搜索到的最优位置为 $\vec{p}_{gbest} = (p_{gbest1}, p_{gbest2}, \cdots, p_{gbestD})$

第1个粒子的位置和速度更新为:

$$v_{id}^{k+1} = wv_{id}^{k} + c_{1}rand()(p_{id} - x_{id}^{k}) + c_{2}rand()(p_{gbest} - x_{id}^{k})$$

$$x_{id}^{k+1} = x_{id}^{k} + v_{id}^{k+1}$$

$$i = 1, 2, \dots, m; \ d = 1, 2, \dots, D$$



◆ 基本粒子群优化算法

* 粒子速度和位置的更新

$$v_{id}^{k+1} = wv_{id}^{k} + c_{1}rand()(p_{id} - x_{id}^{k}) + c_{2}rand()(p_{gbest} - x_{id}^{k})$$

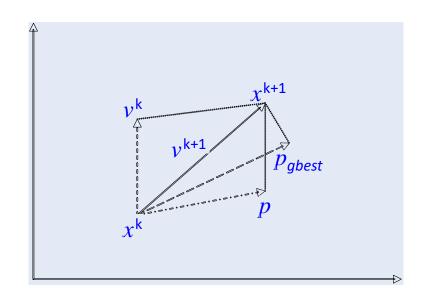
$$x_{id}^{k+1} = x_{id}^{k} + v_{id}^{k+1}$$

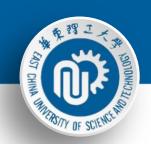
$$i = 1, 2, \dots, m; \ d = 1, 2, \dots, D$$

其中, w称为惯性权重,

 c_1 和 c_2 为两个正常数,称为加速因子。

将 v_{id}^{k} 限制在一个最大速度 v_{max} 内。





◆ 基本粒子群优化算法

* 粒子速度和位置的更新

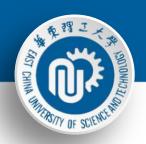
$$v_{id}^{k+1} = (wv_{id}^{k}) + (c_{1}rand()(p_{id} - x_{id}^{k})) + (c_{2}rand()(p_{gbest} - x_{id}^{k}))$$

$$x_{id}^{k+1} \neq x_{id}^{k} + v_{id}^{k+1}$$

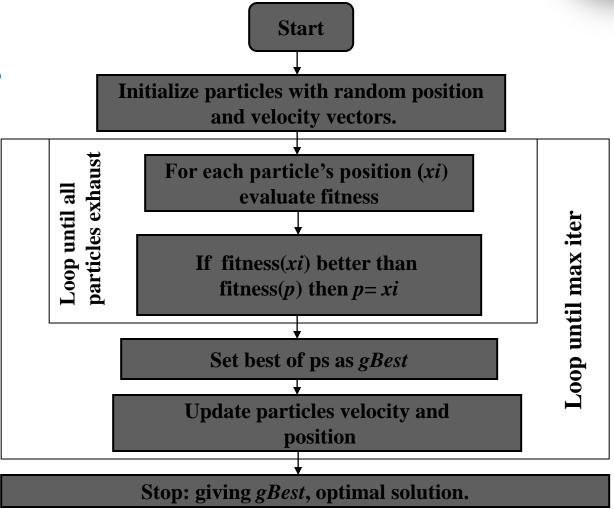
$$i = 1, 2, \dots, m; \ d = 1, 2, \dots, D$$

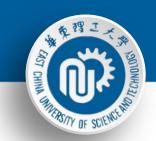
"惯性部分", 对自身运动状态 的信任 "认知部分",对微粒本身的思考,即来源于自己经验的部分

"社会部分",微粒间的信息 共享,来源于群体中的其它优 秀微粒的经验



* 算法流程





- ◆ 粒子群优化算法应用
 - ◆ 求解TSP问题
 - 交换子和交换序

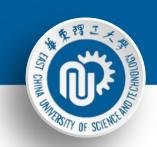
设n个节点的TSP问题的解序列为 $s=(a_i)$, i=1...n。

定义交换子: $SO(i_1,i_2)$ 为交换解S中的点 a_{i1} 和 a_{i2} ,则S'=S+SO (i_1,i_2)

为解S经算子 $SO(i_1,i_2)$ 操作后的新解。

一个或多个交换子的有序队列就是交换序,记作SS,

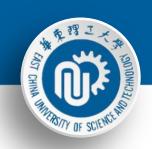
 $SS=(SO_1,SO_2,...SO_N)$ 。其中, $SO_1,...,SO_N$ 等是交换子,之间的顺序是有意义的,意味着所有的交换子依次作用于某解上。



◆ 求解TSP问题

- 符号的定义
 - 若干个交换序可以合并成一个新的交换序, 定义 ① 为两个交换序的合并算子。
- 设两个交换序SS₁和SS₂按先后顺序作用于解S上,得到新解S'。假设另外有一个交换序SS'作用于同一解S上,能够得到相同的解 S',可定义

$$SS' = SS_1 \oplus SS_2$$



◆ 求解TSP问题

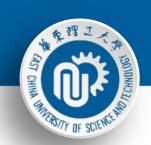
• 符号的定义

SS' 和 $SS_1 \oplus SS_2$ 属于同一等价集,在交换序等价集中,拥有最少交换子的交换序称为该等价集的基本交换序。

解决TSP问题的速度算式定义

$$\begin{cases} v'_{id} = v_{id} \oplus \alpha(p_{id} - x_{id}) \oplus \beta(p_{gd} - x_{id}) \\ x'_{id} = x_{id} + v'_{id} \end{cases}$$

 α 、 β 为 [0,1] 上的随机数。 V_{id} 表示交换序, x_{id} 表示路径序列(解)。



◆ 求解TSP问题

• 算法流程

- 1. 初始化粒子群,给每个粒子一个初始解 (x_{id}) 和随机的交换序 (v_{id}) ;
 - 2. 如果满足结束条件,转步骤5;
 - 3. 根据粒子当前位置 x_{id} 计算下一新解 x_{id} ;
- 4. 如果整个群体找到一个更好的解,更新 P_{gd} ,转步骤2;
 - 5. 显示结果。



◆ 求解TSP问题

算法流程

- 3. 根据粒子当前位置 x_{id} 计算下一新解 x_{id} :
- 1) 计算 $A=p_{id}$ - x_{id} , A是一个基本交换序,表示A作用于 x_{id} 得到 p_{id} ;
- 2) 计算 $B=p_{gd}-x_{id}$, B也是一个基本交换序;
- 3) 更新速度 $v_{id} = v_{id} \oplus \alpha(p_{id} x_{id}) \oplus \beta(p_{gd} x_{id})$ 并将其转换为一个基本交换序;
- 4) 更新解 $x_{id} = x_{id} + v_{id}$;
- 5) 如果找到一个更好得解,更新 p_{id} 。





◆与遗传算法比较

共性

- 1 都属于仿生算法;
- 2 都属于全局优化方法;
- 3 都属于随机搜索算法;
- 4 都隐含并行性;
- 5根据个体的适配信息进行搜索,因此不受函数约束条件的限制,如连续性、可导性等;
- 6对高维复杂问题,往往会遇到早熟收敛和收敛性能差的缺点,都无法保证收敛到最优点。



◆与遗传算法比较

差异

- 1. PSO有记忆,所有粒子都保存较优解的知识,而GA,以前的知识随着种群的改变被改变;
- 2. PSO中的粒子是一种单向共享信息机制。而GA中的染色体之间相互共享信息,使得整个种群都向最优区域移动;
- 3. GA需要编码和遗传操作,而PSO没有交叉和变异操作,粒子只是通过内部速度进行更新,因此原理更简单、参数更少、实现更容易。

课时内容

第6章 机器学习

机器学习系统的基本模型



◆ 学习系统的基本模型

环境

学习系统所感知到的外界信息集合,也是学习系统的外界来源。信息的水平 (一般化程度) 和质量 (正确性) 对学习系统影响较大。

学习环节

对环境提供的信息进行整理、分析归纳或类比,形成知识,并将其放 入知识库。

知识库

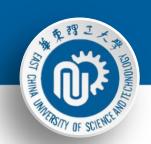
存储经过加工后的信息(即知识)。其表示形式是否合适非常重要。

执行环节

根据知识库去执行一系列任务,并将执行结果或执行过程中获得的信息反馈给学习环节。学习环节再利用反馈信息对知识进行评价,进一步改善执行环节的行为。



示例学习的模型



◆ 示例学习的模型

示例空间

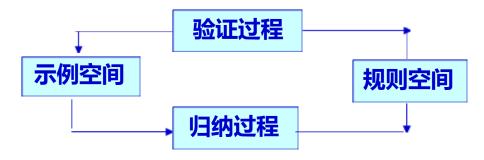
是我们向系统提供的示教例子的集合。研<mark>究问题</mark>:例子质量,搜索方法。 归纳过程

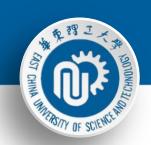
是从搜索到的示例中抽象出一般性的知识的归纳过程。<u>归纳方法</u>:常量 转换为变量,去掉条件,增加选择,曲线拟合等。

规则空间

是事务所具有的各种规律的集合。研究问题:对空间的要求,搜索方法 验证过程

是要从示例空间中选择新的示例,对刚刚归纳出的规则做进一步的验证 和修改。





◆ 把常量化为变量

把示例中的常量换成相应的变量即可得到一个一般性的规则。下面以 扑克牌中同花的概念为例,进行讨论。

假设例子空间中有以下两个关于扑克牌中"同花"概念的示例:

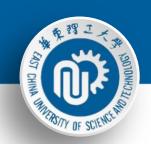
示例1: 花色 $(c_1, 梅花) \wedge 花色(c_2, 梅花) \wedge 花色(c_3, 梅花) \wedge 花色(c_4, 梅花) \wedge 花色(c_5, 梅花) \rightarrow 同花(c_1, c_2, c_3, c_4, c_5)$

示例2: 花色 $(c_1, 红桃)$ \wedge 花色 $(c_2, 红桃)$ \wedge 花色 $(c_3, 红桃)$ \wedge 花色 $(c_4, 红桃)$ \wedge 花色 $(c_5, 红桃)$ \to 同花 $(c_1, c_2, c_3, c_4, c_5)$

其中,示例1表示5张梅花牌是同花,示例2表示5张红桃牌是同花。

对这两个示例,采用把常量化为变量的归纳方法,只要把"梅花"和"红桃"用变量x代换,就可得到如下一般性的规则:

规则1: 花色 $(c_1, x) \wedge 花色(c_2, x) \wedge 花色(c_3, x) \wedge 花色(c_4, x) \wedge 花色(c_5, x) \rightarrow 同花<math>(c_1, c_2, c_3, c_4, c_5)$



◆ 去掉条件

该方法是要把示例中的某些无关的子条件舍去,得到一个一般性的结论例如,有如下示例:

示例3: 花色 $(c_1, 红桃) \land 点数(c_1, 2)$

 \wedge 花色(c_2 , 红桃) \wedge 点数(c_2 , 3)

 \wedge 花色(c_3 , 红桃) \wedge 点数(c_3 , 4)

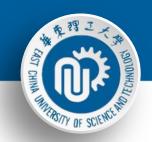
 \wedge 花色(c_4 , 红桃) \wedge 点数(c_4 , 5)

 \wedge 花色(c_5 , 红桃) \wedge 点数(c_5 , 6)

 \rightarrow 同花 $(c_1, c_2, c_3, c_4, c_5)$

为了学习同花的概念,除了需要把常量变为变量外,还需要把与花色 无关的"点数"子条件舍去。这样也可得到上述规则1:

规则1: 花色 $(c_1, x) \wedge 花色(c_2, x) \wedge 花色(c_3, x) \wedge 花色(c_4, x) \wedge$ 花色 (c_5, x) →同花 $(c_1, c_2, c_3, c_4, c_5)$



◆ 增加选择

该方法是要在析取条件中增加一个新的析取项。它包括前件析取法和内部 析取法。

前件析取法:是通过对示例的前件的析取来形成知识的。例如:

示例4: 点数 $(c_1, J) \rightarrow b(c_1)$ 示例5: 点数 $(c_1, Q) \rightarrow b(c_1)$

示例6: 点数 $(c_1, K) \rightarrow b(c_1)$

将各示例的前件进行析取,就可得到所要求的规则:

规则2: 点数 $(c1, J) \lor$ 点数 $(c1, Q) \lor$ 点数 $(c1, K) \rightarrow bb(c1)$

内部析取法:是在示例的表示中使用集合与集合的成员关系来形成知识的。

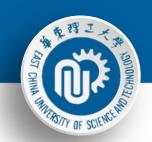
例如,有如下关于"脸牌"的示例:

示例7: 点数c1∈{J}→脸(c1) 示例8: 点数c1∈{Q}→脸(c1)

示例9: 点数c1∈{K}→脸(c1)

用内部析取法,可得到如下规则:

规则3: 点数(c1)∈{J, Q, K}→脸(c1)



◆ 曲线拟合

对数值问题的归纳可采用曲线拟合法。假设示例空间中的每个示例(x, y, z)都是输入x, y与输出z之间关系的三元组。例如,有下3个示例:

示例10: (0, 2, 7)

示例11: (6, -1, 10)

示例12: (-1, -5, -16)

用最小二乘法进行曲线拟合,可得x, y, z之间关系的规则如下:

规则4: z=2x+3y+1

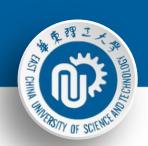
说明:在上述前三种方法中,方法(1)是把常量转换为变量;方法(2)是去掉合取项(约束条件);方法(3)是增加析取项。它们都是要扩大条件的适用范围。从归纳速度上看,方法(1)的归纳速度快,但容易出错;方法(2)归纳速度慢,但不容易出错。因此,在使用方法(1)时应特别小心。例如:

对示例4、示例5及示例6, 若使用方法(1),则会归纳出如下的错误规则:

规则5: (错误) 点数(c1, x)→脸(c1)

它说明,归纳过程是很容易出错的。

决策树的概念



◆ 信息熵和信息增益

信息熵

信息熵是对信息源整体<mark>不确定性的度量</mark>。假设S为样本集,S中所有样本的 类 别 有 k 种 , 如 $y_1,y_2,...,y_k$, 各 种 类 别 样 本 在 S 上 的 概 率 分 布 分 别 为 $P(y_1),P(y_2),...,P(y_k)$,则S的信息熵可定义为:

$$E(s) = -P(y_1)\log P(y_1) - P(y_2)\log P(y_2) - \dots - P(y_r)\log P(y_r)$$

$$= -\sum_{j=1}^{k} P(y_j)\log P(y_j)$$

其中,概率 $P(y_j)$ (j=1,2,...,k),实际上为 y_j 的样本在S中所占的比例;对数可以是以各种数为底的对数,在ID3算法中,我们取以2为底的对数。

E(S)的值越小,S的不确定性越小,即其确定性越高。

决策树的概念



◆ 信息熵和信息增益

信息增益 (information gain)

对两个信息量之间的差的度量。其讨论涉及到样本集S中样本的结构。对S中的每一个样本,除其类别外,还有其条件属性,或简称为属性。若假设S中的样本有m个属性,其属性集为 $x=\{x_1,x_2\dots x_m\}$ 且每个属性均有r种不同的取值,则我们可以根据属性的不同取值将样本集S划分成r个不同的子集 S_1 , S_2 , ... S_r 。

此时,可得到由属性 x_i 的不同取值对样本集合S进行划分后的m权信息熵

$$E(S, x_i) = \sum_{t=1}^r \frac{|S_t|}{|S|} \times E(S_t)$$

其中,t为条件属性 x_j 的属性值: S_t 为 $x_i = t$ 时的样本子集; $E(S_t)$ 为样本子集的信息熵; $JS|\Lambda S$ 分别为样本集S和样本子集S,的大小,即样本个数。

有了信息熵和加权信息熵,就可以计算信息增益。所谓信息增益就是指E(S)和 $E(S,x_i)$ 之间的差,即

$$G(S, x_i) = E(S) - E(S, x_i) = E(S) - \sum_{t=1}^{r} \frac{|S_t|}{|S|} \times E(S_t)$$

可见,信息增益所描述的是信息的确定性,其值越大,信息的确定性越高

决策树学习



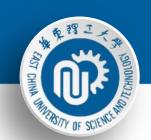
- 机器学习概述
- 记忆学习
- 示例学习
- 决策树学习
 - a. 决策树的概念
 - b. ID3算法
- 统计学习
- 集成学习
- 粗糙集知识发现
- 线性回归



◆ ID3算法的描述

ID3算法的学习过程是一个以整个样本集为根节点,以信息增益最大为原则,选择条件属性进行扩展,逐步构造出决策树的过程。若假设 $S=\{s_1,s_2,...s_n\}$ 为整个样本集, $X=\{x_1,x_2,...,x_m\}$ 为全体属性集, $Y=\{y_1,y_2,...y_k\}$ 为样本类别。则ID3算法描述如下:

- 1. 初始化样本集S={s1,s2,...sn}和属性集X={x1,x2,...,xm}, 生成仅含根节点(S, X)的初始决策树。
- 2. 如果节点样本集中的所有样本全都属于同一类别,则将该节点标记为叶节点, 并标出该叶节点的类别。算法结束。 否则执行下一步。
- 3. 如果属性集为空;或者样本集中的所有样本在属性集上都取相同值,即所有样本都具有相同的属性值,则同样将该节点标记为叶节点算法结束。否则执行下一步。

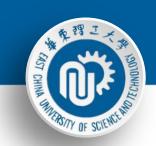


ID3算法的描述

- 4. 计算每个属性的信息增益,并选出信息增益最大的属性对当前决策树进行扩展
- 5. 对选定属性的每一个属性值,重复执行如下操作,至所有属性值全部处理完为 止:
- ① 为每一个属性值生成一个分支;并将样本集中与该分支有关的所有样本放到一起, 形成该新生分支节点的样本子集:
- ② 若样本子集为空,则将此新生分支节点标记为叶节点;
- ③ 否则,若样本子集中的所有样本均属于同一类别,则将该节点标记为叶节点。
- 6. 从属性集中删除所选定的属性,得到新的属性集
- 7. 转到第3步。

6

ID3算法



♦ ID3算法简例(1/9)

例6.1 用ID3算法完成下述学生选课的例子,假设将决策y分为以下 3 类:

y₁: 必修AI

y₂: 选修AI

y₃: 不修AI

对于电信和机电两类专业

做出这些决策的依据有以下3个属性:

 x_1 : 学历层次 $x_1=1$ 研究生, $x_1=2$ 本科

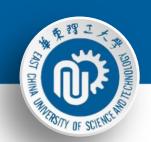
 x_2 : 专业类别 $x_2=1$ 电信类, $x_2=2$ 机电类

x₃: 学习基础 x₃=1 修过AI, x₃=2 未修AI

表1给出了一个关于选课决策的训练例子集S。

6

ID3算法

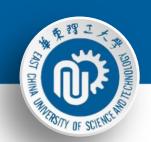


♦ ID3算法简例(2/9)

	属性值			决策方案
序号	x ₁ (层次)	x ₂ (专业)	x ₃ (学否)	y j
1	1	1	1	y ₃
2	1	1	2	y ₁
3	1	2	1	y ₃
4	1	2	2	y ₂
5	2	1	1	y ₃
6	2	1	2	y ₂
7	2	2	1	y ₃
8	2	2	2	y ₃

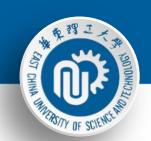
表1 学生选课决策的训练例子集

该训练例子集 S的大小为 8。ID3 算法就是依据这些训练例子,以(S,X)为根节点,按照信息熵下降最大的原则来构造决策树的。



◆ ID3算法简例(3/9)

解:按照ID3算法,先初始化样本集 $S=\{1,2,3,4,5,6,7,8\}$ 和属性集 $X=\{x_1,x_2,x_3\}$ 生成仅含根节点(S,X)的初始决策树。其中,S中的数字为样本集中相应样本的编号。然后通过算法第2、3步,执行其第4步,计算根节点(S,X)关于每一个属性的信息增益,并选择具有最大信息增益的属性对根节点进行扩展。



♦ ID3算法简例(4/9)

可求得各属性的信息增益为:

$$G((S,X), x_1)=E(S,X)-E((S,X), x_1)$$

=1.2988 - 1.1557 =0.1431
 $G((S,X), x_2)=E(S,X)-E((S,X), x_2)$
=1.2988 - 1.1557 =0.1431
 $G((S,X), x_3)=E(S,X)-E((S,X), x_3)$
=1.2988 - 0.75 =0.5488

显然,x3的信息增益最大,因此应先选择x3对根节点进行扩展。

接着执行 5,对 x_3 的所有属性值分别生成根节点(S,X)的不同分支节点。先取 $x_3 = 1$,生成根节点(S,X)的左分支节点。由于t = 1,设所得节点的样本子集为 S_1 ',则有 S_1 '={1,3,5,7}。又由于该样本子集 S_1 中的所有样本均属于同一类别,故将该节点标记为叶节点,并标出其类别 y_3 。

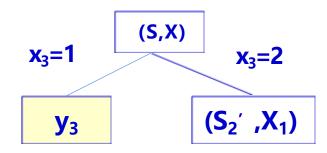


◆ ID3算法简例(5/9)

再取 $x_3=2$, 生成根节点 (S_2) 的右分支节点。由于t=2, 设所得节点的样本子集为 S_2 , 则有 S_2 ={ 2,4,6,8 }。

显然该样本子集非空,且其中的样本并非同一类别,故算法第5步全部完成。

执行第6步,从属性集X={x1,x2,x3}中删除本轮扩展所选定的属性x3,得到新的属性集X1={x1,x2}。至此,根节点(S,X)的扩展过程完成,所得到的当前部分决策树如图所示。



扩展根节点后的部分决策树

然后返回算法第3步,进入下一轮扩展过程。



◆ ID3算法简例(6/9)

显然, 第3步的条件不满足, 接着执行算法第4步

计算节点 (S_2, X_1) 下各属性的信息增益,并选择具有最大信息增益的属性对决策树进行扩展。

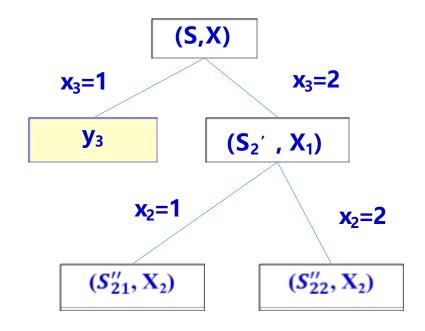
可得: x_2 的信息增益大于 x_1 的信息增益,因此应先扩展属性 x_2 。

接着执行算法第5步,对属性 x_2 的所有取值分别生成节点 (S_2, X_1) 的不同分支节点。当 x_2 =1时,生成其左子节点;当 x_2 =2时,生成其右子节点。



◆ ID3算法简例(7/9)

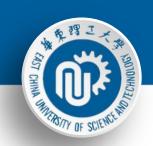
接着执行算法第6步,从当前属性集 $X_1 = \{x_1, x_2\}$ 中删除本轮扩展所选定的属性 x_2 ,得到新的属性集 $X_2 = \{x_1\}$ 。当前的部分决策树如图所示。



扩展根节点(S2′,X1)后的部分决策树

6

ID3算法



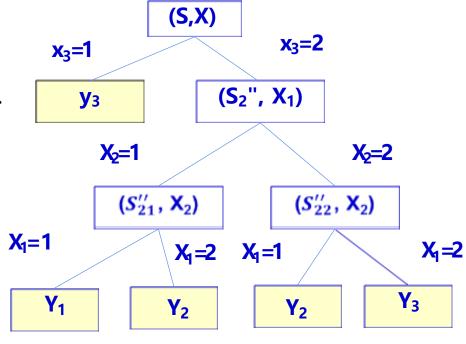
◆ ID3算法简例(8/9)

接着返回算法第3步,进入下一轮扩展过程。由于第3步中的条件都不满足,故执行第4步。由于此时属性集X中只有x₁,无须再进行属性选择,直接执行算法第5步,对属性x₁的所有取值,依次完成对各非叶节点的扩展,并将所有新生分支节点标记为叶节点。

执行算法第6步,此时从X2={ x1 } 中删除属性 x1,当前属性集为空;

返回算法第3步,此时因属性集为空,算法结束。

右图为最终所得完整决策树。



最终得到的完整决策树

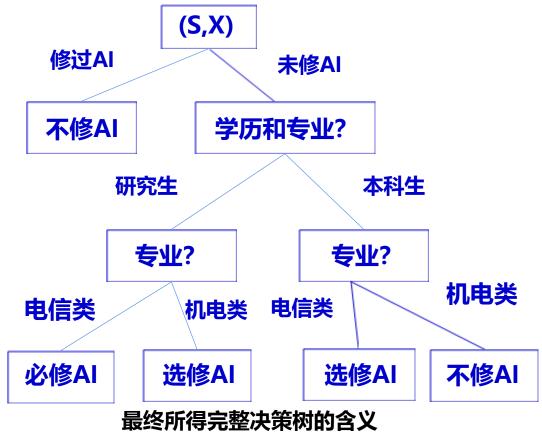
6

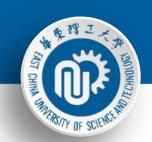
ID3算法



◆ ID3算法简例(9/9)

上述该决策树的含义如图所示。其中,从根节点到每个叶节点的路径都 代表了一条知识。

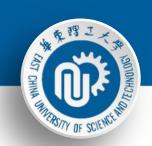




◆ 集成学习的基本概念

集成学习是指为解决同一问题,先训练出一系列个体学习器(或称弱学习器),然后再根据某种规则把这些个体学习器的学习结果整合到一起,得到比单个个体学习器更好的学习效果。集成学习的基本结构如下图所示。

集成学习包括两大基本问题,一个是个体学习器的构造,另一个 是个体学习器的合成。



◆ 集成学习的两种方式

> 同质集成

要求构造个体学习器时使用相同类型的学习方法,构造出来的多个个体学习器为同质学习器。

所谓同质,是指同一类型,例如要使用决策树都为决策树。 这种采用相同学习方法构造个体学习器的集成学习称为<mark>狭义集成学习,</mark> 其个体学习器称为基学习器,所用的学习算法称为基学习算法。

> 异质集成

不要求构造个体学习器时使用同一类型的学习方法,而是可以异质。 所谓异质,是指不同类型,例如可以同时使用决策树和神经网络去构造 个体学习器。

这种集成学习又称为广义集成学习,构造个体学习器所用学习算法不再 称基学习算法,构造出来的个体学习器也不再称基学习器,而直接称其为个 体学习器。



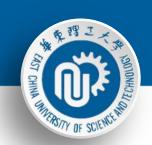
◆ 集成学习的基本类型

根据个体学习器生成方式的不同,以及个体学习器之间依赖关系的不同,集成学习可分为Boosting方法和Bagging方法两大基本类。

Boosting方法的基本思想:

- a) 从初始训练集开始,先为每个训练样本平均分配初始权重,并训练出弱学习器1;
- b) 然后通过提高错误率高的训练样本的权重,降低错误率低的训练样本的 权重,得到训练样本的新的权重分布,并在在该权重分布上训练出弱学 习器2;
- c) 依此逐轮迭代,直至达到最大迭代轮数,最后再将训练出来的这些弱学 习器合成到一起,形成最终的强学习器。

其典型代表是AdaBoost算法和提升树(boosting tree)算法。



◆ 集成学习的基本类型

Bagging方法则不同, 其基本思想为:

在给定初始训练集和弱学习算法的前提下,每轮迭代都使用可重 采样的随机抽样方法式从初始训练集产生出本轮的训练子集。

并利用选定的弱学习算法训练出本轮迭代的弱学习器,依此逐轮 迭代,直至达到最大迭代轮数。

最后再按照某种合成方式将这这些训练出来的弱学习器合成到一起, 形成最终的强学习器。

其典型代表包括bagging算法和随机森林 (Random Forest) 算法等。