

Definicja przestrzeni probabilistycznej

Rozkładem prawdopodobieństwa P w pewnym zbiorze zdarzeń elementarnych $\Omega \neq \emptyset$ nazywamy odwzorowanie

$$P : \Sigma \mapsto [0; 1],$$

gdzie Σ jest rodziną podzbiorów Ω (inaczej rodziną zdarzeń) taką, że

$$\Omega \in \Sigma, \quad A \in \Sigma \implies A' \in \Sigma, \quad \forall A_1, A_2, \dots \in \Sigma : \bigcup_i A_i \in \Sigma,$$

które spełnia: $P(\Omega) = 1$ oraz dla dowolnych parami rozłącznych zdarzeń $A_1, A_2, \dots \in \Sigma$ zachodzi

$$P\left(\bigcup_i A_i\right) = \sum_i P(A_i).$$

Trójkę (Ω, Σ, P) nazywamy przestrzenią probabilistyczną. Z powyższej definicji wynikają znane własności prawdopodobieństwa tj. $P(A') = 1 - P(A)$ oraz $P(A \cup B) = P(A) + P(B) - P(A, B)$.

Prawdopodobieństwo warunkowe

Definiujemy również prawdopodobieństwo warunkowe zdarzenia A pod warunkiem zdarzenia B o dodatnim prawdopodobieństwie

$$P(A | B) := \frac{P(A, B)}{P(B)}.$$

Na podstawie powyższej definicji definiujemy niezależność zdarzeń A, B jako własność $P(A, B) = P(A)P(B)$, co dla zdarzenia B o dodatnim prawdopodobieństwie jest równoważne z $P(A | B) = P(A)$. Ponadto jeśli zdarzenia $A_1, A_2, \dots \in \Sigma$ są parami rozłączne i zachodzi $\bigcup_i A_i = \Omega$ to dla dowolnego zdarzenia $B \in \Sigma$ możemy zapisać

$$P(B) = \sum_i P(B | A_i)P(A_i).$$

Z definicji prawdopodobieństwa warunkowego trywialnie udowodnić twierdzenie Bayesa

$$P(A | B) = \frac{P(B | A)P(A)}{P(B)}.$$

Zmienne losowe

W uczeniu maszynowym będą interesować nas zmienne o wartościach w \mathbb{R}^n . Zmienne takie nazywamy zmiennymi losowymi wielowymiarowymi i definiujemy jako odwzorowania

$$X : \Omega \mapsto \mathbb{R}^n$$

takie, że dla każdego $A \subseteq \mathbb{R}^n$ zbiór $\{\omega \in \Omega \mid X(\omega) \in A\}$ należy do rodziny zdarzeń Σ . Przy takiej definicji prawdopodobieństwo, iż zmienna X ma wartość należącą do pewnego przedziału A wynosi

$$P(X \in A) = P(\{\omega \in \Omega \mid X(\omega) \in A\}).$$

Dowolny rozkład prawdopodobieństwa zmiennej losowej n -wymiarowej $X = (X_1, X_2, \dots, X_n)$ jest wyznaczony jednoznacznie przez zadanie funkcji $F(\mathbf{x}) : \mathbb{R}^n \mapsto [0; 1]$ zwanej dystrybuantą zdefiniowanej jako

$$F(\mathbf{x}) = F(x_1, \dots, x_n) := P(X_1 \leq x_1, \dots, X_n \leq x_n).$$

Zasadniczo będą nas interesować jednak dwa przypadki rozkładów prawdopodobieństwa zmiennych losowych: rozkłady dyskretne i rozkłady ciągłe. W przypadku rozkładu dyskretnego istnieje pewien przeliczalny zbiór $S \subset \mathbb{R}^n$ taki, że $P(X \in S) = 1$. Rozkład ten jest zadany jednoznacznie przez podanie $|S|$ liczb $p_i > 0$ określających prawdopodobieństwa $p_i = P(X = \mathbf{x}_i)$ dla wszystkich $\mathbf{x}_i \in S$. W przypadku rozkładu ciągłego istnieje z kolei funkcja $p(\mathbf{x}) : \mathbb{R}^n \mapsto [0; \infty)$ taka, że

$$P(X_1 \in [a_1; b_1], \dots, X_n \in [a_n; b_n]) = \int_{a_1}^{b_1} \cdots \int_{a_n}^{b_n} p(\mathbf{x}) d^n \mathbf{x}.$$

Funkcje $p(\mathbf{x})$ nazywamy gęstością prawdopodobieństwa. W obu przypadkach musi być spełniony warunek unormowania postaci odpowiednio

$$\sum_i p_i = 1, \quad \int_{\mathbb{R}^n} p(\mathbf{x}) d^n \mathbf{x} = 1.$$

Będziemy często wykorzystywać wartość oczekiwaną pewnej funkcji $f(\mathbf{x})$ zmiennej losowej X zdefiniowaną odpowiednio dla rozkładu p – dyskretnego lub ciągłego jako

$$\mathbb{E}[f(\mathbf{x})] := \sum_{\mathbf{x}_i \in S} f(\mathbf{x}_i) p_i \cong \int_{\mathbb{R}^n} f(\mathbf{x}) p(\mathbf{x}) d^n \mathbf{x}.$$

Zauważmy przy tym, iż funkcja $f(\mathbf{x})$ może być zupełnie dowolna, np. dla funkcji charakterystycznej (indykatorowej) zbioru $A \subset \mathbb{R}^n$ $f(\mathbf{x}) = \mathcal{I}_A$ mamy $\mathbb{E}[\mathcal{I}_A(\mathbf{x})] = P(X \in A)$ lub dla iloczynu funkcji Heaviside'a $f(\mathbf{x}) = \theta(t_1 - x_1) \cdots \theta(t_n - x_n)$ mamy $\mathbb{E}[f(\mathbf{x})] = F(t_1, \dots, t_n)$.

Rozkłady brzegowe

Niech $X = (X_1, \dots, X_n)$ będzie n -wymiarową zmienną losową o dystrybucie $F(\mathbf{x})$. Rozkład brzegowy względem k zmiennych $X_{\sigma(1)}, \dots, X_{\sigma(k)}$ definiujemy jako rozkład wyznaczony przez dystrybuantę

$$F_{X_{\sigma(1)}, \dots, X_{\sigma(k)}}(x_{\sigma(1)}, \dots, x_{\sigma(k)}) := \lim_{x_{\sigma(k+1)} \rightarrow \infty, \dots, x_{\sigma(n)} \rightarrow \infty} F(x_1, \dots, x_n).$$

Zmienne losowe niezależne

Niech $X = (X_1, \dots, X_k)$ będzie n -wymiarową zmienną losową o rozkładzie wyznaczonym przez dystrybuantę $F(\mathbf{x})$. Powiemy, iż zmienne losowe n_1, \dots, n_k - wymiarowych ($n_1 + \dots + n_k = n$) X_1, \dots, X_k są niezależne iff dla dowolnych $\mathbf{x}_1 \in \mathbb{R}^{n_1}, \dots, \mathbf{x}_k \in \mathbb{R}^{n_k}$ zachodzi

$$F(\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_k) = F_{X_1}(\mathbf{x}_1) \cdot \dots \cdot F_{X_k}(\mathbf{x}_k).$$

Rozkłady warunkowe

W ogólnym przypadku zmiennej losowej n - wymiarowej $Z = (Z_1, \dots, Z_n)$ o ciągłym rozkładzie $p(\mathbf{z})$ jeśli wydzielimy zmienne k i $n - k$ - wymiarowe $X = (Z_{\sigma(1)}, \dots, Z_{\sigma(k)})$, $Y = (Z_{\sigma(k+1)}, \dots, Z_{\sigma(n)})$ to rozkład warunkowy zmiennej $X | Y$ definiujemy jako rozkład zadany przez gęstość prawdopodobieństwa

$$p(\mathbf{x} | \mathbf{y}) := \frac{p(\mathbf{z})}{p_Y(\mathbf{y})} = \frac{p(\mathbf{x}, \mathbf{y})}{p_Y(\mathbf{y})}.$$

Transformacja zmiennych wielowymiarowych

Niech $X = (X_1, \dots, X_n)$ będzie zmienną losową wielowymiarową o rozkładzie ciągłym o gęstości $p_X(\mathbf{x})$. Rozważmy bijekcję $(X_1, \dots, X_n) \mapsto (Y_1, \dots, Y_n)$. Chcemy znaleźć wyrażenie na gęstość $p_Y(\mathbf{y})$ w nowych zmiennych. Ponieważ infinitesimalne prawdopodobieństwo jest niezmiennicze względem zmiany współrzędnych więc zachodzi

$$p_X(x_1, \dots, x_n) dx_1 \dots dx_n = p_Y(y_1, \dots, y_n) dy_1 \dots dy_n,$$

skąd

$$p_Y(y_1, \dots, y_n) = \left| \frac{\partial(x_1, \dots, x_n)}{\partial(y_1, \dots, y_n)} \right| p_X(x_1(\mathbf{y}), \dots, x_n(\mathbf{y})).$$

Macierz kowariancji

Macierz kowariancji funkcji $f(\mathbf{x})$ zmiennej losowej X definiujemy jako

$$\mathbf{\Sigma}[f(\mathbf{x})] := \mathbb{E}[(f(\mathbf{x}) - \boldsymbol{\mu}_f)(f(\mathbf{x}) - \boldsymbol{\mu}_f)^\top],$$

gdzie $\boldsymbol{\mu}_f = \mathbb{E}[f(\mathbf{x})]$. Elementy diagonalne Σ_{ii} tej macierzy nazywamy wariancjami zmiennych X_i , natomiast elementy pozadiagonalne Σ_{ij} nazywamy kowariancjami zmiennych X_i i X_j . Oczywiście $\mathbf{\Sigma}$ jest macierzą symetryczną. Nadto jeśli f jest funkcją identycznościową tj. $f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}$ to $\mathbf{\Sigma}$ jest macierzą nieujemnie określoną, gdyż dla dowolnego $\mathbf{v} \in \mathbb{R}^n$ mamy

$$\mathbf{v}^\top \mathbf{\Sigma} \mathbf{v} = \mathbb{E}[\mathbf{v}^\top (\mathbf{x} - \boldsymbol{\mu})(\mathbf{x} - \boldsymbol{\mu})^\top \mathbf{v}] = \mathbb{E}[z^2] \geq 0,$$

gdzie $z = \mathbf{v}^\top (\mathbf{x} - \boldsymbol{\mu}) \in \mathbb{R}$. Jeśli X_1, \dots, X_n są niezależne i f jest funkcją identycznościową to $\mathbf{\Sigma}$ jest macierzą diagonalną.

Wielowymiarowy rozkład normalny

Jeśli zmienna wielowymiarowa $X = (X_1, \dots, X_n)$ ma wielowymiarowy rozkład normalny (z ang. *Multivariate Normal distribution – MVN*) z wartością oczekiwaną $\boldsymbol{\mu}$ i macierzą kowariancji $\boldsymbol{\Sigma}$, co oznaczamy jako $X \sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}, \boldsymbol{\Sigma})$, to gęstość prawdopodobieństwa jest dana

$$\phi(\mathbf{x}) = \frac{1}{\sqrt{(2\pi)^n \det \boldsymbol{\Sigma}}} \exp \left\{ -\frac{1}{2}(\mathbf{x} - \boldsymbol{\mu})^\top \boldsymbol{\Sigma}^{-1}(\mathbf{x} - \boldsymbol{\mu}) \right\}$$

Macierz $\boldsymbol{\Lambda} = \boldsymbol{\Sigma}^{-1}$ nazywamy macierzą precyzji. Jeśli \mathbf{v}_i są unormowanymi wektorami własnymi macierzy $\boldsymbol{\Sigma}$, a λ_i odpowiadającymi im wartościami własnymi i zakładając, iż widmo $\{\lambda_i\}$ jest niezdegenerowane mamy z twierdzenia spektralnego

$$\boldsymbol{\Lambda} = \sum_{i=1}^n \frac{1}{\lambda_i} \mathbf{v}_i \mathbf{v}_i^\top$$

oraz wiemy, iż wektory $\{\mathbf{v}_i\}$ tworzą bazę ortonormalną przestrzeni \mathbb{R}^n . Z powyższego możemy zatem wyrazić wektor $\mathbf{x} - \boldsymbol{\mu}$ jako kombinację liniową wektorów $\{\mathbf{v}_i\}$ tj.

$$\mathbf{x} - \boldsymbol{\mu} = \sum_{i=1}^n t_i \mathbf{v}_i,$$

co pozwala zapisać gęstość prawdopodobieństwa jako

$$\phi(t_1, \dots, t_n) \cong \exp \left\{ -\frac{1}{2} \sum_{i=1}^n \frac{t_i^2}{\lambda_i} \right\}.$$

Z powyższego wzoru widać, iż poziomice gęstości są wielowymiarowymi elipsoidami, których półosie są skierowane wzdłuż wektorów własnych $\boldsymbol{\Sigma}$ i mają długości proporcjonalne do $\sqrt{\lambda_i}$.

Powiemy, iż wielowymiarowa zmienna losowa $X \sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}, \boldsymbol{\Sigma})$ ma standardowy wielowymiarowy rozkład normalny jeśli $\boldsymbol{\mu} = \mathbf{0}$ i $\boldsymbol{\Sigma} = \mathbf{1}$. Wówczas

$$\phi(\mathbf{x}) = \frac{1}{\sqrt{(2\pi)^n}} \exp \left\{ -\frac{1}{2} \mathbf{x}^\top \mathbf{x} \right\}.$$

Można wykazać, iż jeśli $X \sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}, \boldsymbol{\Sigma})$ dla $\boldsymbol{\Sigma}$ o niezdegenerowanym widmie to wszystkie rozkłady brzegowe i warunkowe X są rozkładami normalnymi.

Zbieżność w rachunku prawdopodobieństwa

W rachunku prawdopodobieństwa definiujemy trzy zasadnicze rodzaje zbieżności ciągu zmiennych losowych (X_n) .

- Ciąg (X_n) jest zbieżny do X stochastycznie iff

$$\forall \epsilon > 0 : \lim_{n \rightarrow \infty} P(|X_n - X| < \epsilon) = 1.$$

- Ciąg (X_n) jest zbieżny do X z prawdopodobieństwem 1 iff

$$P\left(\lim_{n \rightarrow \infty} X_n = X\right) = 1.$$

- Ciąg (X_n) n -wymiarowych zmiennych losowych jest zbieżny do X według dystrybuant iff

$$\forall \mathbf{x} \in \mathbb{R}^n, F_X(\mathbf{x}) - \text{ciągła w } \mathbf{x} : \lim_{n \rightarrow \infty} F_{X_n}(\mathbf{x}) = F_X(\mathbf{x})$$

Pomiędzy tak zdefiniowanymi rodzajami zbieżności zachodzą następujące implikacje:

1. $X_n \rightarrow X$ z prawdopodobieństwem 1 $\implies X_n \rightarrow X$ stochastycznie
2. $X_n \rightarrow X$ stochastycznie $\implies X_n \rightarrow X$ według dystrybuant
3. $X_n \rightarrow X$ stochastycznie \implies istnieje podciąg (X_{n_k}) zbieżny do X z prawdopodobieństwem 1

Wnioskowanie statystyczne

Modelem statystycznym nazwiemy parę (χ, \mathcal{P}) , gdzie \mathcal{P} jest rodziną rozkładów prawdopodobieństwa w zbiorze χ , przy czym będziemy zakładać $\chi = \mathbb{R}^n$

$$\mathcal{P} := \{p(\mathbf{x} \mid \theta) \mid \theta \in \Theta\},$$

gdzie Θ jest zbiorem parametrów modelu \mathcal{P} . Prostą próbą losową w modelu \mathcal{P} nazwiemy ciąg niezależnych zmiennych losowych X_1, \dots, X_n o wartościach w \mathbb{R}^n i pochodzących z tego samego rozkładu $p(\mathbf{x} \mid \theta) \in \mathcal{P}$ (w angielskiej terminologii taki ciąg zmiennych losowych nazwiemy *i.i.d.* tj. *independent and identically distributed*). Statystyką z kolei nazwiemy zmienną losową T będącą funkcją prostej próby losowej tj. $T = T(X_1, \dots, X_n)$. Być może najważniejszym przykładem statystyki jest średnia oznaczana jako \bar{X}

$$\bar{X}(X_1, \dots, X_n) := \frac{X_1 + \dots + X_n}{n}.$$

Wartość oczekiwana statystyki średniej $\bar{X}(X_1, \dots, X_n)$ dla X_i z rozkładu $X \sim \mathcal{D}$ o gęstości p wynosi

$$\mathbb{E}[\bar{X}] = \int \dots \int \frac{1}{n} \left(\sum_{i=1}^n X_i \right) p(X_1) \dots p(X_n) dX_1 \dots dX_n = \mathbb{E}[X].$$

Wariancja statystyki średniej wynosi z kolei

$$\begin{aligned}
\text{Var}[\bar{X}] &= \mathbb{E}[\bar{X}^2] - \mathbb{E}[\bar{X}]^2 \\
&= \int \cdots \int \frac{1}{n^2} \left(\sum_{i=1}^n X_i^2 + \underbrace{\sum_{i \neq j} X_i X_j}_{n(n-1)} \right) p(X_1) \cdots p(X_n) dX_1 \cdots dX_n - \mathbb{E}[X]^2 \\
&= \frac{1}{n} \mathbb{E}[X^2] + \frac{n(n-1)}{n^2} \mathbb{E}[X]^2 - \mathbb{E}[X]^2 = \frac{1}{n} [\mathbb{E}[X^2] - \mathbb{E}[X]^2] = \frac{1}{n} \text{Var}[X].
\end{aligned}$$

Silne prawo wielkich liczb

Niech (X_n) będzie ciągiem zmiennych losowych i.i.d. z pewnego rozkładu $X \sim \mathcal{D}$. Przez (\bar{X}_n) oznaczmy ciąg średnich częściowych tj.

$$\bar{X}_n = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X_i.$$

Wówczas zachodzi silne prawo wielkich liczb

$$P\left(\lim_{n \rightarrow \infty} \bar{X}_n = \mathbb{E}[X]\right) = 1,$$

czyli średnia próbek zbiega do wartości oczekiwanej z prawdopodobieństwem 1.

Silne prawo wielkich liczb daje nam potężne narzędzie do szacowania wartości oczekiwanych, gdyż możemy je przybliżać średnią z dużej liczby próbek losowych, a dokładność tego przybliżenia zależy jedynie od liczby próbek i wariancji X . Jeśli X jest zmienną wielowymiarową to dokładność przybliżenia nie zależy wprost od liczby wymiarów i unikamy tzw. *curse of dimensionality*.

Centralne Twierdzenie Graniczne

Niech (X_n) będzie ciągiem k -wymiarowych zmiennych losowych i.i.d. z dowolnego rozkładu $X \sim \mathcal{D}$ o wartości oczekiwanej $\boldsymbol{\mu} = \mathbb{E}[\mathbf{x}]$ i odwracalnej macierzy kowariancji $\boldsymbol{\Sigma}$. Oznaczając przez (\bar{X}_n) ciąg średnich częściowych ciągu (X_n) zachodzi

$$\sqrt{n} (\bar{X}_n - \boldsymbol{\mu}) \rightarrow Z \sim \mathcal{N}(\mathbf{0}, \boldsymbol{\Sigma}).$$

Oznacza to, iż dla ciągu X_1, \dots, X_n zmiennych losowych i.i.d. z praktycznie dowolnego rozkładu $X \sim \mathcal{D}$ dla odpowiednio dużych n średnią z próbek możemy traktować jako zmienną losową o rozkładzie normalnym $\mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}, n^{-1/2} \boldsymbol{\Sigma})$.

Estymatory punktowe MLE i MAP

Rozważamy model statystyczny $\mathcal{P} = \{p(\mathbf{x} | \theta) | \theta \in \Theta\}$. Estymatorem parametru θ nazwiemy statystykę $\hat{\theta}(X_1, \dots, X_n)$ służącą do oszacowania wartości tego

parametru. Wartość tej statystyki dla konkretnej realizacji prostej próby losowej $\theta(\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_n)$ nazwiemy estymatą parametru θ . Dodatkowo definiujemy obciążenie (z ang. *bias*) estymatora jako wielkość

$$\mathbb{B}[\hat{\theta}] := \mathbb{E}[\hat{\theta}] - \theta.$$

Zasadniczo będą nas interesować dwa rodzaje estymat: MLE i MAP. W przypadku estymaty MLE (z ang. *Maximum Likelihood Estimate*) definiujemy funkcję wiarygodności (*likelihood*) dla modelu $\mathcal{P} = \{p(\mathbf{x} | \theta) | \theta \in \Theta\}$ i realizacji prostej próby losowej (którą nazwiemy również danymi lub obserwacjami) $D = (\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_n)$ jako

$$p(D | \theta) = \prod_{i=1}^n p(\mathbf{x}_i | \theta).$$

Estymatą MLE nazywamy taką wartość parametru $\theta_{\text{MLE}} \in \Theta$, że

$$p(D | \theta_{\text{MLE}}) = \max_{\theta \in \Theta} p(D | \theta).$$

Ponieważ znajdowanie maksimum funkcji będącej iloczynem nie jest zadaniem przyjemnym (choćby obliczanie pochodnych iloczynu funkcji jest trudniejsze od sumy), więc wprowadzamy zanegowaną logarytmiczną funkcję wiarygodności

$$\ell(D | \theta) = -\log p(D | \theta) = -\sum_{i=1}^n \log p(\mathbf{x}_i | \theta),$$

wówczas ze względu na fakt, iż funkcja $\log x$ jest ściśle rosnąca estymatę MLE możemy równoważnie wyznaczyć jako

$$\ell(D | \theta_{\text{MLE}}) = \min_{\theta \in \Theta} \ell(D | \theta).$$

Funkcję ℓ będziemy również nazywać funkcją kosztu.

W przypadku estymaty MAP (z ang. *Maximum a posteriori estimate*) wprowadzamy gęstość rozkładu a posteriori jako

$$p(\theta | D) = \frac{1}{Z} p(D | \theta) \pi(\theta),$$

gdzie Z jest stałą wynikającą z warunku unormowania, a $\pi(\theta)$ to gęstość prawdopodobieństwa opisująca rozkład a priori parametru θ . Estymatą MAP nazywamy taką wartość parametru $\theta_{\text{MAP}} \in \Theta$, że

$$p(\theta_{\text{MAP}} | D) = \max_{\theta \in \Theta} p(\theta | D).$$

Zauważmy przy tym iż liczba Z nie jest nam potrzebna, gdyż wystarczy zmaksymalizować licznik tj.

$$\theta_{\text{MAP}} = \arg \max_{\theta \in \Theta} p(D | \theta) \pi(\theta).$$

Wnioskowanie Bayesowskie

Zajmiemy się teraz wnioskowaniem opartym na twierdzeniu Bayesa. Rozpatrujemy model statystyczny $\mathcal{P} = \{p(\mathbf{x} \mid \theta) \mid \theta \in \Theta\}$. Załóżmy, iż mamy obserwacje $D = (\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_n)$, wówczas twierdzenie Bayesa możemy zapisać jako

$$p(\theta \mid D) = \frac{p(D \mid \theta)\pi(\theta)}{p_D(D)} = \frac{p(D \mid \theta)\pi(\theta)}{\int_{\Theta} p(D \mid \theta)\pi(\theta) d\theta},$$

gdzie $p(\theta \mid D)$ nazywamy rozkładem a posteriori (posteriorem), $p(D \mid \theta)$ – wiarygodnością (likelihood), a $\pi(\theta)$ – rozkładem a priori (priorem).

Całe wnioskowanie Bayesowskie opiera się na wyznaczeniu rozkładu a posteriori, który wyraża całą naszą wiedzę o estymowanym parametrze θ . Na podstawie tego rozkładu możemy wyznaczyć estymatę punktową MAP, jak również niepewność związaną z wyznaczeniem tej estymaty np. poprzez wyznaczenie przedziału wiarygodności $C_{1-\alpha}(\theta \mid D) = [\theta_l; \theta_u]$ takiego, że

$$P(\theta \in [\theta_l; \theta_u] \mid D) = 1 - \alpha,$$

dla ustalonego $0 < \alpha < 1$. Możemy również skonstruować rozkład predykcyjny (z ang. *posterior predictive distribution*) określający prawdopodobieństwo zaobserwowania nowej obserwacji \mathbf{x}

$$p(\mathbf{x} \mid D) = \int_{\Theta} p(\mathbf{x} \mid \theta)p(\theta \mid D) d\theta.$$

Modele Gaussowskie

Jak już wspomnieliśmy w przypadku gdy zmienna losowa ma wielowymiarowy rozkład normalny $\mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}, \boldsymbol{\Sigma})$ wszystkie rozkłady brzegowe i warunkowe są również rozkładami normalnymi. W szczególnym przypadku gdy zmienne k i $n - k$ – wymiarowe \mathbf{x} i \mathbf{y} mają łącznie rozkład normalny

$$\begin{bmatrix} \mathbf{x} \\ \mathbf{y} \end{bmatrix} \sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}, \boldsymbol{\Sigma}),$$

gdzie

$$\boldsymbol{\mu} = \begin{bmatrix} \boldsymbol{\mu}_{\mathbf{x}} \\ \boldsymbol{\mu}_{\mathbf{y}} \end{bmatrix}, \quad \boldsymbol{\Sigma} = \begin{bmatrix} \boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{xx}} & \boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{xy}} \\ \boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{yx}} & \boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{yy}} \end{bmatrix}$$

można pokazać iż

$$\mathbf{x} \mid \mathbf{y} \sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}_{\mathbf{x}|\mathbf{y}}, \boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{x}|\mathbf{y}}), \quad \mathbf{y} \sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}_{\mathbf{y}}, \boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{yy}}),$$

gdzie

$$\begin{aligned} \boldsymbol{\mu}_{\mathbf{x}|\mathbf{y}} &= \boldsymbol{\mu}_{\mathbf{x}} + \boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{xy}}\boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{yy}}^{-1}(\mathbf{y} - \boldsymbol{\mu}_{\mathbf{y}}) \\ \boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{x}|\mathbf{y}} &= \boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{xx}} - \boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{xy}}\boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{yy}}^{-1}\boldsymbol{\Sigma}_{\mathbf{yx}} \end{aligned}.$$

Liniowe modele Gaussowskie

Powyższe własności rozkładów łącznych pozwalają jawnie wnioskować w tzw. liniowych modelach Gaussowskich (z ang. *Linear Gaussian Models*). Załóżmy, iż nasze obserwacje są modelowane przez n -wymiarową zmienną losową \mathbf{y} o rozkładzie normalnym z estymowanym parametrem \mathbf{x} i znanymi parametrami $\mathbf{A}, \mathbf{b}, \Sigma_{\mathbf{y}}$ tak, że wiarygodność ma postać

$$\mathbf{y} \mid \mathbf{x} \sim \mathcal{N}(\mathbf{Ax} + \mathbf{b}, \Sigma_{\mathbf{y}}),$$

gdzie \mathbf{A} jest macierzą wymiaru $n \times k$. Jako prior na parametr \mathbf{x} przyjmujemy również rozkład normalny o pewnych zadanych parametrach $\mu_{\mathbf{x}}, \Sigma_{\mathbf{x}}$ (taki wybór rozkładu a priori nazywamy rozkładem sprzężonym do wiarygodności)

$$\mathbf{x} \sim \mathcal{N}(\mu_{\mathbf{x}}, \Sigma_{\mathbf{x}}).$$

Wówczas łatwo pokazać, iż rozkład a posteriori jest rozkładem normalnym

$$\mathbf{x} \mid \mathbf{y} \sim \mathcal{N}(\mu_{\mathbf{x}|\mathbf{y}}, \Sigma_{\mathbf{x}|\mathbf{y}})$$

z parametrami

$$\begin{aligned} \Sigma_{\mathbf{x}|\mathbf{y}} &= \left[\Sigma_{\mathbf{x}}^{-1} + \mathbf{A}^{\top} \Sigma_{\mathbf{y}}^{-1} \mathbf{A} \right]^{-1} \\ \mu_{\mathbf{x}|\mathbf{y}} &= \Sigma_{\mathbf{x}|\mathbf{y}} \left[\mathbf{A}^{\top} \Sigma_{\mathbf{y}}^{-1} (\mathbf{y} - \mathbf{b}) + \Sigma_{\mathbf{x}}^{-1} \mu_{\mathbf{x}} \right] \end{aligned}.$$

Założmy teraz, iż mamy ciąg obserwacji $(\mathbf{y}_1, \dots, \mathbf{y}_m)$. Wnioskowanie Bayesowskie możemy wówczas stosować iteracyjnie tzn. na początku dla 0 obserwacji rozkład estymowanego parametru jest opisany przez prior $\mathcal{N}(\mu_0, \Sigma_0)$. Po zaobserwowaniu jednego \mathbf{y}_1 aktualizujemy nasze przekonania co do parametru \mathbf{x} zgodnie z powyższym wzorem i otrzymujemy rozkład normalny o parametrach

$$\begin{aligned} \Sigma_1 &= \left[\Sigma_0^{-1} + \mathbf{A}^{\top} \Sigma_{\mathbf{y}}^{-1} \mathbf{A} \right]^{-1} \\ \mu_1 &= \Sigma_1 \left[\mathbf{A}^{\top} \Sigma_{\mathbf{y}}^{-1} (\mathbf{y}_1 - \mathbf{b}) + \Sigma_0^{-1} \mu_0 \right] \end{aligned}.$$

Po zaobserwowaniu kolejnego \mathbf{y}_2 ponownie wykorzystujemy powyższe wzory ale jako prior wykorzystując rozkład w poprzedniej iteracji. W ogólności możemy zapisać wzór rekurencyjny na $m+1$ rozkład jako

$$\begin{aligned} \Sigma_{m+1} &= \left[\Sigma_m^{-1} + \mathbf{A}^{\top} \Sigma_{\mathbf{y}}^{-1} \mathbf{A} \right]^{-1} \\ \mu_{m+1} &= \Sigma_{m+1} \left[\mathbf{A}^{\top} \Sigma_{\mathbf{y}}^{-1} (\mathbf{y}_{m+1} - \mathbf{b}) + \Sigma_m^{-1} \mu_m \right] \end{aligned},$$

skąd możemy od razu podać wzór na parametry m -tego rozkładu

$$\begin{aligned} \Sigma_m &= \left[\Sigma_0^{-1} + m \mathbf{A}^{\top} \Sigma_{\mathbf{y}}^{-1} \mathbf{A} \right]^{-1} \\ \mu_m &= \Sigma_m \left[\mathbf{A}^{\top} \Sigma_{\mathbf{y}}^{-1} \left(\sum_{i=1}^m \mathbf{y}_i - m \mathbf{b} \right) + \Sigma_0^{-1} \mu_0 \right] \end{aligned}.$$

Taki sam wynik można by uzyskać rozpatrując łączny rozkład a posteriori dla obserwacji $D = (\mathbf{y}_1, \dots, \mathbf{y}_m)$ tj.

$$p(\mathbf{x} \mid D) \cong \pi(\mathbf{x}) \prod_{i=1}^m p(\mathbf{y}_i \mid \mathbf{x}) \cong \exp \left\{ -\frac{1}{2} \left[(\mathbf{x} - \boldsymbol{\mu}_0)^\top \boldsymbol{\Sigma}_0^{-1} (\mathbf{x} - \boldsymbol{\mu}_0) + \sum_{i=1}^m (\mathbf{y}_i - \mathbf{A}\mathbf{x} - \mathbf{b})^\top \boldsymbol{\Sigma}_y^{-1} (\mathbf{y}_i - \mathbf{A}\mathbf{x} - \mathbf{b}) \right] \right\}.$$

Regresja liniowa

Założmy, iż modelujemy obserwacje postaci (y, \mathbf{x}) gdzie y to skalar zwany zmienną objaśnianą, którego wartość obserwujemy, a \mathbf{x} to wektor zmiennych objaśniających, który kontrolujemy tj. zakładamy, iż wektor \mathbf{x} dla danego pomiaru y znamy dokładnie. Dodatkowo zakładamy, iż y zależy liniowo od \mathbf{x} tj.

$$y = \mathbf{w}^\top \mathbf{x} + \epsilon,$$

gdzie $\epsilon \sim \mathcal{N}(0, \sigma^2)$ dla znanego σ jest tzw. błędem losowym, a \mathbf{w} jest estymowanym przez nas parametrem. Możemy zatem zapisać

$$y \mid \mathbf{w} \sim \mathcal{N}(\mathbf{w}^\top \mathbf{x}, \sigma^2).$$

Powiedzmy, iż zaobserwowaliśmy ciąg obserwacji $D = (y_1, \dots, y_m)$ dla zadanych (lub dokładnie znanych) przez nas $(\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_m)$. Wiarygodność ma zatem postać

$$p(D \mid \mathbf{w}) \cong \prod_{i=1}^m \exp \left\{ -\frac{1}{2\sigma^2} (y_i - \mathbf{w}^\top \mathbf{x}_i)^2 \right\}.$$

W przypadku regresji liniowej zamiast pełnego wnioskowania Bayesowskiego o parametrze \mathbf{w} często stosuje się prostsze podejście polegające na znalezieniu estymaty punktowej MLE. Zanegowana logarytmiczna funkcja wiarygodności ma postać

$$\ell(D \mid \mathbf{w}) = \frac{1}{2\sigma^2} \sum_{i=1}^m (y_i - \mathbf{w}^\top \mathbf{x}_i)^2 + \text{const.}$$

Człon stały możemy oczywiście pominąć i zapisać

$$\ell(D \mid \mathbf{w}) \cong \sum_{i=1}^m (y_i - \mathbf{w}^\top \mathbf{x}_i)^2 = (\mathbf{y} - \mathbf{X}\mathbf{w})^\top (\mathbf{y} - \mathbf{X}\mathbf{w}),$$

gdzie

$$\mathbf{y} = \begin{bmatrix} y_1 \\ \vdots \\ y_m \end{bmatrix}, \quad \mathbf{X} = \begin{bmatrix} \mathbf{x}_1^\top \\ \vdots \\ \mathbf{x}_m^\top \end{bmatrix}.$$

Ponieważ otrzymana funkcja ℓ ma postać formy kwadratowej, więc problem optymalizacyjny polegający na znalezieniu minimum ℓ nazywa się metodą najmniejszych kwadratów (z ang. *OLS – Ordinary Least Squares*). Aby wyznaczyć estymatę \mathbf{w}_{MLE} musimy rozwiązać równanie

$$\frac{\partial \ell}{\partial \mathbf{w}} = \frac{\partial}{\partial \mathbf{w}} \left[\mathbf{y}^\top \mathbf{y} + \mathbf{w}^\top \mathbf{X}^\top \mathbf{X} \mathbf{w} - 2\mathbf{y}^\top \mathbf{X} \mathbf{w} \right] = \mathbf{0},$$

skąd

$$2\mathbf{X}^\top \mathbf{X} \mathbf{w} - 2\mathbf{X}^\top \mathbf{y} = \mathbf{0},$$

zatem

$$\mathbf{w}_{\text{MLE}} = (\mathbf{X}^\top \mathbf{X})^{-1} \mathbf{X}^\top \mathbf{y}.$$

Pełniejszą informację o parametrze \mathbf{w} możemy uzyskać rozpatrując rozkład a posteriori $p(\mathbf{w} \mid D)$. Jeśli jako prior przyjmujemy rozkład normalny z pewnymi parametrami $\boldsymbol{\mu}_0, \boldsymbol{\Sigma}_0$ to zauważmy, iż otrzymujemy instancję liniowego modelu Gaussowskiego

$$\begin{aligned} \mathbf{y} \mid \mathbf{w} &\sim \mathcal{N}(\mathbf{X}\mathbf{w}, \sigma^2 \mathbf{1}) \\ \mathbf{w} &\sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}_0, \boldsymbol{\Sigma}_0) \end{aligned},$$

skąd rozkład a posteriori jest rozkładem normalnym

$$\mathbf{w} \mid \mathbf{y} \sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}_m, \boldsymbol{\Sigma}_m)$$

o parametrach

$$\begin{aligned} \boldsymbol{\Sigma}_m &= \left[\boldsymbol{\Sigma}_0^{-1} + \sigma^{-2} \mathbf{X}^\top \mathbf{X} \right]^{-1} \\ \boldsymbol{\mu}_m &= \boldsymbol{\Sigma}_m \left[\sigma^{-2} \mathbf{X}^\top \mathbf{y} + \boldsymbol{\Sigma}_0^{-1} \boldsymbol{\mu}_0 \right]. \end{aligned}$$

W powyższych wzorach nazwy parametrów nie są przykładowe: po zaobserwowaniu 0 przykładów rozkład parametru \mathbf{w} jest rozkładem a priori $\mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}_0, \boldsymbol{\Sigma}_0)$; po zaobserwowaniu po jednej wartości y_i w m zadanych (znanych dokładnie) punktach \mathbf{x}_i otrzymujemy rozkład a posteriori $\mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}_m, \boldsymbol{\Sigma}_m)$. Gdybyśmy w każdym z m punktów \mathbf{x}_i dokonywali pomiaru y_i s -krotnie to wtedy wykorzystując wzory wyprowadzone przy iteracyjnym stosowaniu wnioskowania w liniowym modelu Gaussowskim otrzymujemy rozkład normalny o parametrach

$$\begin{aligned} \boldsymbol{\Sigma}_{m;s} &= \left[\boldsymbol{\Sigma}_0^{-1} + \frac{s}{\sigma^2} \mathbf{X}^\top \mathbf{X} \right]^{-1} \\ \boldsymbol{\mu}_{m;s} &= \boldsymbol{\Sigma}_{m;s} \left[\sigma^{-2} \mathbf{X}^\top \sum_{i=1}^s \mathbf{y}_i + \boldsymbol{\Sigma}_0^{-1} \boldsymbol{\mu}_0 \right]. \end{aligned}$$

Rozkład predykcyjny dla nowej obserwacji y poczynionej w punkcie \mathbf{x} jest dany przez

$$p(y \mid \mathbf{y}) = \int_{\mathbb{R}^n} p(y \mid \mathbf{w}) p(\mathbf{w} \mid \mathbf{y}) d^n \mathbf{w}.$$

Nietrudno zauważyć, iż będzie to rozkład normalny o parametrach

$$\begin{aligned}\mu_{y|\mathbf{y}} &= \mathbb{E}[y | \mathbf{y}] = \int_{\mathbb{R}} yp(y | \mathbf{y}) dy = \int_{\mathbb{R}^n} d^n \mathbf{w} p(\mathbf{w} | \mathbf{y}) \int_{\mathbb{R}} dy yp(y | \mathbf{w}) \\ &= \int_{\mathbb{R}^n} d^n \mathbf{w} p(\mathbf{w} | \mathbf{y}) \mathbf{x}^\top \mathbf{w} = \mathbf{x}^\top \boldsymbol{\mu}_m.\end{aligned}$$

oraz

$$\begin{aligned}\sigma_{y|\mathbf{y}}^2 &= \mathbb{E}[(y - \mu_{y|\mathbf{y}})^2 | \mathbf{y}] = \int_{\mathbb{R}^n} d^n \mathbf{w} p(\mathbf{w} | \mathbf{y}) \int_{\mathbb{R}} dy (y - \mu_{y|\mathbf{y}})^2 p(y | \mathbf{w}) \\ &= \int_{\mathbb{R}^n} d^n \mathbf{w} p(\mathbf{w} | \mathbf{y}) \int_{\mathbb{R}} dy (y^2 + \mu_{y|\mathbf{y}}^2 - 2\mu_{y|\mathbf{y}}y) p(y | \mathbf{w}) \\ &= \int_{\mathbb{R}^n} d^n \mathbf{w} p(\mathbf{w} | \mathbf{y}) (\sigma^2 + (\mathbf{x}^\top \mathbf{w})^2 + \mu_{y|\mathbf{y}}^2 - 2\mu_{y|\mathbf{y}} \mathbf{x}^\top \mathbf{w}) \\ &= \sigma^2 + \int_{\mathbb{R}^n} d^n \mathbf{w} p(\mathbf{w} | \mathbf{y}) (\mathbf{x}^\top \mathbf{w} - \mathbf{x}^\top \boldsymbol{\mu}_m)^2 \\ &= \sigma^2 + \mathbf{x}^\top \mathbb{E}[(\mathbf{w} - \boldsymbol{\mu}_m)(\mathbf{w} - \boldsymbol{\mu}_m)^\top | \mathbf{y}] \mathbf{x} = \sigma^2 + \mathbf{x}^\top \boldsymbol{\Sigma}_m \mathbf{x}.\end{aligned}$$

Powyżej skorzystaliśmy ze znanego faktu, iż dla jednowymiarowej zmiennej losowej zachodzi $\sigma^2 = \mathbb{E}[(X - \mu_X)^2] = \mathbb{E}[X^2] - \mu_X^2$, skąd $\mathbb{E}[X^2] = \sigma^2 + \mu_X^2$. Podsumowując rozkład predykcyjny ma postać

$$y | \mathbf{y} \sim \mathcal{N}(\mathbf{x}^\top \boldsymbol{\mu}_m, \sigma^2 + \mathbf{x}^\top \boldsymbol{\Sigma}_m \mathbf{x}).$$

Regularyzacja

Regularyzacją nazywamy proces polegający na wprowadzeniu ad hoc do zagadnienia optymalizacji dodatkowych członów tak, aby rozwiązanie było „regularne” (prostsze, nieosobliwe, jednoznaczne ...). W przypadku funkcji kosztu ℓ najczęściej dodajemy człon penalizujący rozwiązanie o dużej normie estymowanego parametru postaci

$$\gamma \|\theta\|$$

dla pewnej normy $\|\cdot\|$ i hiper-parametru γ określającego siłę regularyzacji. W kontekście Bayesowskim regularyzację można również rozumieć jako pewną niechęć („tłumienie”, zachowawczość) modelu do zmiany rozkładu a priori estymowanego parametru po pojawieniu się kolejnych obserwacji.

Przykładowo jeśli w zagadnieniu Bayesowskiej regresji liniowej jako prior przyjmujemy rozkład normalny

$$\mathbf{w} \sim \mathcal{N}(\mathbf{0}, \tau^2 \mathbf{1})$$

to rozkład a posteriori jest rozkładem normalnym o parametrach

$$\begin{aligned}\boldsymbol{\Sigma}_m &= \sigma^2 \left[\gamma \mathbf{1} + \mathbf{X}^\top \mathbf{X} \right]^{-1} \\ \boldsymbol{\mu}_m &= \left[\gamma \mathbf{1} + \mathbf{X}^\top \mathbf{X} \right]^{-1} \mathbf{X}^\top \mathbf{y} \end{aligned}$$

gdzie $\gamma = \sigma^2/\tau^2$ jest hiper-parametrem określającym siłę regularyzacji. Zauważmy, że im większa jest wartość γ (mniejsza niepewność związana z rozkładem a priori) tym drugi człon w nawiasie staje się mniej istotny. Taki sam wynik możemy uzyskać metodą OLS jeśli do funkcji kosztu dodamy człon regularyzujący dla zwykłej normy euklidesowej. Zagadnienie minimalizacji funkcji kosztu będącej formą kwadratową z dodanym członem regularyzującym nazywamy również regresją grzbietową.

Procesy Gaussowskie

Jak już wspomnieliśmy macierz kowariancji n -wymiarowej zmiennej losowej \mathbf{x} o wartości oczekiwanej $\boldsymbol{\mu}$ jest zdefiniowana jako

$$\boldsymbol{\Sigma} = \mathbb{E} [(\mathbf{x} - \boldsymbol{\mu})(\mathbf{x} - \boldsymbol{\mu})^\top] .$$

Pokazaliśmy również, iż macierz ta jest nieujemnie określona. Dodatkowo pokażemy, iż dla każdej nieujemnie określonej macierzy symetrycznej \mathbf{K} wymiaru $n \times n$ istnieje n -wymiarowa zmienna losowa o wielowymiarowym rozkładzie normalnym dla której \mathbf{K} jest macierzą kowariancji. Istotnie dla każdej nieujemnie określonej macierzy symetrycznej istnieje macierz \mathbf{L} taka, że

$$\mathbf{K} = \mathbf{L}\mathbf{L}^\top ,$$

jest to tzw. dekompozycja Choleskiego. Niech $\mathbf{z} \sim \mathcal{N}(\mathbf{0}, \mathbf{1})$, wówczas zmienna losowa \mathbf{Lz} ma rozkład o zerowej wartości oczekiwanej i macierzy kowariancji

$$\mathbb{E} [(\mathbf{Lz})(\mathbf{Lz})^\top] = \mathbb{E} [\mathbf{Lzz}^\top \mathbf{L}^\top] = \mathbf{L}\mathbb{E}[\mathbf{zz}^\top] \mathbf{L}^\top = \mathbf{L}\mathbf{1}\mathbf{L}^\top = \mathbf{K} .$$

Powyższe własności wskazują, iż macierze kowariancji można w pewnym sensie utożsamiać z nieujemnie określonymi macierzami symetrycznymi.

Zdefiniujemy teraz funkcję kowariancji $k : \mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^n \mapsto \mathbb{R}$ taką, że $\forall m \in \mathbb{N} : \forall X = \{\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_m\} \subset \mathbb{R}^n$ macierz

$$k(X, X) = \begin{bmatrix} k(\mathbf{x}_1, \mathbf{x}_1) & k(\mathbf{x}_1, \mathbf{x}_2) & \cdots & k(\mathbf{x}_1, \mathbf{x}_m) \\ k(\mathbf{x}_2, \mathbf{x}_1) & k(\mathbf{x}_2, \mathbf{x}_2) & \cdots & k(\mathbf{x}_2, \mathbf{x}_m) \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ k(\mathbf{x}_m, \mathbf{x}_1) & k(\mathbf{x}_m, \mathbf{x}_2) & \cdots & k(\mathbf{x}_m, \mathbf{x}_m) \end{bmatrix}$$

jest dodatnio określoną macierzą symetryczną. Funkcję k nazywamy również jądrem dodatnio określonym (z ang. *positive definite kernel*) lub jądrem Mercera.

Dla dwóch zbiorów punktów $X = \{\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_m\} \subset \mathbb{R}^n$ i $Y = \{\mathbf{y}_1, \dots, \mathbf{y}_s\} \subset \mathbb{R}^n$ i funkcji kowariancji k wprowadzimy oznaczenie

$$k(X, Y) := \begin{bmatrix} k(\mathbf{x}_1, \mathbf{y}_1) & k(\mathbf{x}_1, \mathbf{y}_2) & \cdots & k(\mathbf{x}_1, \mathbf{y}_s) \\ k(\mathbf{x}_2, \mathbf{y}_1) & k(\mathbf{x}_2, \mathbf{y}_2) & \cdots & k(\mathbf{x}_2, \mathbf{y}_s) \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ k(\mathbf{x}_m, \mathbf{y}_1) & k(\mathbf{x}_m, \mathbf{y}_2) & \cdots & k(\mathbf{x}_m, \mathbf{y}_s) \end{bmatrix}.$$

Poniżej podajemy kilka przykładów funkcji kowariancji

- *Gaussian kernel* dla normy $\|\cdot\|$ i hiper-parametru l

$$k(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = \exp \left\{ -\frac{1}{2l^2} \|\mathbf{x} - \mathbf{y}\|^2 \right\}$$

- *Periodic kernel* dla normy $\|\cdot\|$ i hiper-parametrów l, p

$$k(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = \exp \left\{ -\frac{2}{l^2} \sin^2 \left(\frac{\pi}{p} \|\mathbf{x} - \mathbf{y}\| \right) \right\}$$

- *White noise kernel* dla hiper-parametru σ

$$k(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = \sigma^2 \delta_{\mathbf{x}, \mathbf{y}}$$

- *Matérn kernel* dla normy $\|\cdot\|$ i hiper-parametrów l, ν

$$k(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = \frac{2^{1-\nu}}{\Gamma(\nu)} \left(\frac{\sqrt{2\nu}}{l} \|\mathbf{x} - \mathbf{y}\| \right)^\nu K_\nu \left(\frac{\sqrt{2\nu}}{l} \|\mathbf{x} - \mathbf{y}\| \right),$$

gdzie $\Gamma(x)$ to funkcja gamma Eulera, a $K_\nu(x)$ to zmodyfikowana funkcja Bessela 2-go rodzaju rzędu ν .

Dodatkowo suma lub iloczyn dwóch funkcji kowariancji oraz złożenie funkcji kowariancji z wielomianem o nieujemnych współczynnikach jest również funkcją kowariancji.

Procesem Gaussowskim (z ang. *Gaussian Process*) nazywamy rodzinę skalarnych zmiennych losowych indeksowanych przez punkty $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n$

$$\mathcal{GP} = \{f_{\mathbf{x}} \mid \mathbf{x} \in \mathbb{R}^n\}$$

taką że każdy skończony podzbiór \mathcal{GP} ma łącznie wielowymiarowy rozkład normalny tj. dla dowolnego zbioru $X = \{\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_m\} \subset \mathbb{R}^n$ zachodzi

$$\begin{bmatrix} f_{\mathbf{x}_1} \\ \vdots \\ f_{\mathbf{x}_m} \end{bmatrix} \sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}_X, \boldsymbol{\Sigma}_X).$$

Zauważmy, iż process Gaussowski możemy jednoznacznie zdefiniować podając „przepisy” na parametry $\boldsymbol{\mu}_X$ i $\boldsymbol{\Sigma}_X$ dla dowolnego zbioru X . W praktyce często przyjmujemy $\boldsymbol{\mu}_X = \mathbf{0}$, natomiast przepisem na macierz kowariancji może być zdefiniowana wyżej funkcja kowariancji $k(X, X)$ tj.

$$\begin{bmatrix} f_{\mathbf{x}_1} \\ \vdots \\ f_{\mathbf{x}_m} \end{bmatrix} \sim \mathcal{N}(\mathbf{0}, k(X, X)).$$

Process Gaussowski daje nam w praktyce rozkład prawdopodobieństwa nad funkcjami $f : \mathbb{R}^n \mapsto \mathbb{R}$, których charakter jest określony przez jądro k (np. funkcja gładka dla jądra Gaussowskiego, okresowa dla jądra periodycznego, itp.). Zauważmy, że nie wnioskujemy tu o parametrach konkretnej rodziny funkcji (jak w przypadku regresji liniowej); interesuje nas jedynie rozkład predykcyjny. Załóżmy, iż w zadanych (lub dokładnie znanych) przez nas punktach $X = \{\mathbf{x}_1, \mathbf{x}_2, \dots, \mathbf{x}_m\}$ zaobserwowaliśmy wartości pewnej funkcji, o których zakładamy, iż pochodzą z procesu Gaussowskiego zadanego jądrem k , które wyraża nasze założenia a priori co do charakteru badanej funkcji

$$\mathbf{f}_X = \begin{bmatrix} f_{\mathbf{x}_1} \\ \vdots \\ f_{\mathbf{x}_m} \end{bmatrix} \sim \mathcal{N}(\mathbf{0}, k(X, X)).$$

Powiedzmy, iż chcemy znać wartości \mathbf{f}_Y tej funkcji w zadanych punktach $Y = \{\mathbf{y}_1, \mathbf{y}_2, \dots, \mathbf{y}_s\}$. Ponieważ założyliśmy, iż wartości funkcji pochodzą z procesu Gaussowskiego, więc rozkład łączny \mathbf{f}_X i \mathbf{f}_Y jest rozkładem normalnym

$$\begin{bmatrix} \mathbf{f}_X \\ \mathbf{f}_Y \end{bmatrix} \sim \mathcal{N}\left(\mathbf{0}, \begin{bmatrix} k(X, X) & k(X, Y) \\ k(Y, X) & k(Y, Y) \end{bmatrix}\right).$$

Zauważmy, iż jest to instancja modelu Gaussowskiego, więc rozkład warunkowy $\mathbf{f}_Y \mid \mathbf{f}_X$ jest również rozkładem normalnym o parametrach

$$\begin{aligned} \boldsymbol{\mu} &= k(Y, X)k^{-1}(X, X)\mathbf{f}_X \\ \boldsymbol{\Sigma} &= k(Y, Y) - k(Y, X)k^{-1}(X, X)k(X, Y) \end{aligned}.$$

Dodatkową niepewność związaną z pomiarem wartości \mathbf{f}_X możemy uchwycić zmieniając postać jądra

$$k(\mathbf{x}, \mathbf{y}) \leftarrow k(\mathbf{x}, \mathbf{y}) + \mathcal{I}_X(\mathbf{x})\sigma^2\delta_{\mathbf{x}, \mathbf{y}},$$

gdzie σ jest hiper-parametrem określającym precyzję pomiaru. Oczywiście k jest dalej funkcją kowariancji, gdyż takie podstawienie powoduje jedynie dodanie dodatnich członów do pewnych elementów diagonalnych macierzy kowariancji, więc macierz ta jest nadal symetryczna i dodatnio określona. Wówczas rozkład predykcyjny ma parametry

$$\begin{aligned} \boldsymbol{\mu} &= k(Y, X) [k(X, X) + \sigma^2 \mathbf{1}]^{-1} \mathbf{f}_X \\ \boldsymbol{\Sigma} &= k(Y, Y) - k(Y, X) [k(X, X) + \sigma^2 \mathbf{1}]^{-1} k(X, Y) \end{aligned}.$$

Wieloklasowa regresja logistyczna

Założmy, iż modelujemy obserwacje postaci (t, \mathbf{x}) , gdzie $t \in \{\tau_1, \tau_2, \dots, \tau_s\}$ to etykieta określająca przynależność do jednej z s klas, a $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n$ jest znanym (lub zadany) przez nas dokładnie wektorem cech obiektu dla których zaobserwowaną klasą jest t . Zakładamy ponadto, iż prawdopodobieństwo przynależności do klasy τ_j (jednej z s klas) dla wektora cech \mathbf{x} ma postać tzw. funkcji softmax

$$\pi_j(\mathbf{x}) = \frac{1}{Z(\mathbf{x})} e^{\mathbf{w}_j^\top \mathbf{x}},$$

gdzie \mathbf{w}_j są estymowanymi przez nas parametrami. Ze względu na warunek unormowania musimy mieć

$$\sum_{j=1}^s \pi_j = 1,$$

skąd stała normalizacyjna $Z(\mathbf{x})$ ma postać

$$Z(\mathbf{x}) = \sum_{j=1}^s e^{\mathbf{w}_j^\top \mathbf{x}}.$$

Rozkład zmiennej losowej t jest w takim razie dyskretnym rozkładem wielopunktowym (z ang. *categorical distribution*) postaci

$$t \mid \mathbf{w}_1, \dots, \mathbf{w}_s \sim \text{Cat}(\pi_1(\mathbf{x}), \dots, \pi_s(\mathbf{x})).$$

Zauważmy, iż prawdopodobieństwo wylosowania etykiety t dla parametrów \mathbf{w}_j możemy zapisać jako

$$p(t \mid \mathbf{w}_1, \dots, \mathbf{w}_s) = \prod_{j=1}^s \pi_j(\mathbf{x})^{\delta(t, \tau_j)}.$$

Powiedzmy, że mamy obserwacje $D = (t_1, \dots, t_m)$ dla znanych (lub zadanych) przez nas dokładnie wektorów cech $(\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_m)$. Funkcja wiarygodności ma wówczas postać

$$p(D \mid \mathbf{w}_1, \dots, \mathbf{w}_s) = \prod_{i=1}^m p(t_i \mid \mathbf{w}_1, \dots, \mathbf{w}_s) = \prod_{i=1}^m \prod_{j=1}^s \pi_j(\mathbf{x}_i)^{\delta(t_i, \tau_j)}.$$

Jako prior dla parametrów \mathbf{w}_j przyjmijmy rozkład normalny z pewnym hiperparametrem γ

$$\forall j \in \{1, \dots, s\} : \mathbf{w}_j \sim \mathcal{N}(\mathbf{0}, \gamma^{-1} \mathbf{1}).$$

W przypadku regresji logistycznej ograniczymy się do znalezienia estymaty MAP parametrów \mathbf{w}_j tak, aby w przyszłości do nowego wektora cech \mathbf{x} przyporządkować klasę o największym prawdopodobieństwie $\pi_j(\mathbf{x})$. Znalezienie estymaty

MAP sprowadza się do znalezienia minimum zregulowanej funkcji kosztu

$$\begin{aligned}\ell^*(D \mid \mathbf{w}_1, \dots, \mathbf{w}_s) &= -\log[p(D \mid \mathbf{w}_1, \dots, \mathbf{w}_s)\pi(\mathbf{w}_1, \dots, \mathbf{w}_s)] \\ &= -\log \left[\prod_{k=1}^s e^{-\frac{\gamma}{2} \mathbf{w}_k^\top \mathbf{w}_k} \prod_{i=1}^m \prod_{j=1}^s \pi_j(\mathbf{x}_i)^{\delta(t_i, \tau_j)} \right] \\ &= \frac{\gamma}{2} \sum_{j=1}^s \mathbf{w}_j^\top \mathbf{w}_j - \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^s \delta(t_i, \tau_j) \log \pi_j(\mathbf{x}_i).\end{aligned}$$

Niestety dla tak zdefiniowanej funkcji kosztu nie można znaleźć wzoru na minimum w postaci analitycznej, dlatego wykorzystamy numeryczny algorytm optymalizacji zwany spadkiem wzdłuż gradientu.

Metoda spadku wzdłuż gradientu

Algorytm spadku wzdłuż gradientu (z ang. *gradient descent*) dla funkcji $f(\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_m)$ ma postać

1. Wybierz parametry początkowe $\mathbf{x}_1^{(0)}, \dots, \mathbf{x}_m^{(0)}$
2. Powtarzaj

$$\begin{aligned}\mathbf{x}_1^{(t+1)} &= \mathbf{x}_1^{(t)} - \epsilon_1 \frac{\partial f}{\partial \mathbf{x}_1} \Big|_{\mathbf{x}_1^{(t)}, \dots, \mathbf{x}_m^{(t)}} \\ &\vdots \\ \mathbf{x}_m^{(t+1)} &= \mathbf{x}_m^{(t)} - \epsilon_m \frac{\partial f}{\partial \mathbf{x}_m} \Big|_{\mathbf{x}_1^{(t)}, \dots, \mathbf{x}_m^{(t)}}\end{aligned}$$

gdzie $\epsilon_1, \dots, \epsilon_m$ to hiper-parametry zwane stałymi uczącymi (z ang. *learning rate*).

Zakładając $\epsilon_1 = \dots = \epsilon_m = \epsilon$ i wprowadzając

$$\mathbf{X} := \begin{bmatrix} \mathbf{x}_1^\top \\ \vdots \\ \mathbf{x}_m^\top \end{bmatrix}, \quad \frac{\partial f}{\partial \mathbf{X}} := \begin{bmatrix} \frac{\partial f}{\partial \mathbf{x}_1}^\top \\ \vdots \\ \frac{\partial f}{\partial \mathbf{x}_m}^\top \end{bmatrix}$$

możemy zapisać powyższe równania w kompaktowej formie

$$\mathbf{X}^{(t+1)} = \mathbf{X}^{(t)} - \epsilon \frac{\partial f}{\partial \mathbf{X}} \Big|_{\mathbf{X}^{(t)}}.$$

Aby zminimalizować numerycznie funkcję kosztu ℓ^* stosując metodę spadku wzdłuż gradientu musimy obliczyć pochodne funkcji kosztu po parametrach \mathbf{w}_j

$$\frac{\partial \ell^*}{\partial \mathbf{w}_k} = \gamma \mathbf{w}_k - \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^s \delta(t_i, \tau_j) \frac{\partial}{\partial \mathbf{w}_k} \log \pi_j(\mathbf{x}_i),$$

ale

$$\begin{aligned} \frac{\partial}{\partial \mathbf{w}_k} \log \pi_j(\mathbf{x}_i) &= \frac{1}{\pi_j(\mathbf{x}_i)} \frac{Z(\mathbf{x}_i) \frac{\partial e^{\mathbf{x}_i^\top \mathbf{w}_j}}{\partial \mathbf{w}_k} - e^{\mathbf{x}_i^\top \mathbf{w}_j} \frac{\partial Z(\mathbf{x}_i)}{\partial \mathbf{w}_k}}{Z^2(\mathbf{x}_i)} \\ &= \frac{Z(\mathbf{x}_i)}{e^{\mathbf{x}_i^\top \mathbf{w}_j}} \frac{Z(\mathbf{x}_i) \mathbf{x}_i e^{\mathbf{x}_i^\top \mathbf{w}_k} \delta_{jk} - e^{\mathbf{x}_i^\top \mathbf{w}_j} e^{\mathbf{x}_i^\top \mathbf{w}_k} \mathbf{x}_i}{Z^2(\mathbf{x}_i)} \\ &= \mathbf{x}_i \delta_{jk} - \mathbf{x}_i \pi_k(\mathbf{x}_i) \end{aligned}$$

zatem

$$\frac{\partial \ell^*}{\partial \mathbf{w}_k} = \gamma \mathbf{w}_k - \sum_{i=1}^m \mathbf{x}_i \sum_{j=1}^s \delta(t_i, \tau_j) \delta_{jk} + \sum_{i=1}^m \mathbf{x}_i \pi_k(\mathbf{x}_i) \sum_{j=1}^s \delta(t_i, \tau_j).$$

Zauważmy jednak, iż

$$\sum_{j=1}^s \delta(t_i, \tau_j) = 1, \quad \sum_{j=1}^s \delta(t_i, \tau_j) \delta_{jk} = \delta(t_i, \tau_k),$$

zatem ostatecznie

$$\frac{\partial \ell^*}{\partial \mathbf{w}_k} = \gamma \mathbf{w}_k + \sum_{i=1}^m \mathbf{x}_i [\pi_k(\mathbf{x}_i) - \delta(t_i, \tau_k)].$$

Wprowadzając macierze

$$\mathbf{X} = \begin{bmatrix} \mathbf{x}_1^\top \\ \vdots \\ \mathbf{x}_m^\top \end{bmatrix}, \quad \mathbf{W} = \begin{bmatrix} \mathbf{w}_1^\top \\ \vdots \\ \mathbf{w}_s^\top \end{bmatrix},$$

$$\mathbf{S} = \begin{bmatrix} \pi_1(\mathbf{x}_1) & \cdots & \pi_s(\mathbf{x}_1) \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ \pi_1(\mathbf{x}_m) & \cdots & \pi_s(\mathbf{x}_m) \end{bmatrix}, \quad \mathbf{T} = \begin{bmatrix} \delta(t_1, \tau_1) & \cdots & \delta(t_1, \tau_s) \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ \delta(t_m, \tau_1) & \cdots & \delta(t_m, \tau_s) \end{bmatrix}$$

możemy w takim razie zapisać zdefiniowaną wyżej macierz pochodnych wymaganych do algorytmu spadku wzdłuż gradient w kompaktowej formie jako

$$\frac{\partial \ell^*}{\partial \mathbf{W}} = (\mathbf{S} - \mathbf{T})^\top \mathbf{X}.$$

Zauważmy, iż zregularyzowana funkcja kosztu rośnie wraz ze wzrostem liczby obserwacji m . Wynika z tego, iż stała ucząca musi być zależna od liczby przykładów. Możemy na przykład stwierdzić, iż $\epsilon \leftarrow m^{-1}\epsilon$ i wówczas minimalizujemy tak naprawdę średni koszt ℓ^*/m .

Wnioskowanie metodami Monte Carlo

Całe wnioskowanie Bayesowskie opiera się na wyznaczaniu rozkładów a posteriori, które wyrażają naszą wiedzę o estymowanym parametrze. Do tej pory rozważaliśmy modele Bayesowskie dla których prior i wiarygodność były dane przez rozkłady normalne. Dzięki temu mogliśmy wyprowadzić analityczne wzory na parametry rozkładu a posteriori, który również był rozkładem normalnym. Dla wielu interesujących modeli nie jesteśmy jednak w stanie tego zrobić (np. w zagadnieniu regresji logistycznej ograniczyliśmy się jedynie do estymaty punktowej), gdyż obliczenie stałej normalizującej dla rozkładu $p(\theta | D)$ może wymagać obliczenia całki, której nie jesteśmy w stanie wyrazić w sposób jawny lub sumy po wykładniczo wielu elementach. Wnioskowanie Bayesowskie można jednak prowadzić w modelach, w których nie dysponujemy jawnym wzorem na gęstość prawdopodobieństwa rozkładu a posteriori. Okazuje się, iż do generowania próbek z rozkładu $p(\theta | D)$ wystarczy znajomość tego rozkładu z dokładnością do stałej normalizującej, a zatem wystarczy znać rozkład łączny $p(\theta, D) = p(D | \theta)\pi(\theta)$. Generowanie próbek z kolei wystarczy natomiast, na mocy silnego prawa wielkich liczb, do szacowania wartości średnich dowolnych funkcji estymowanego parametru θ . Przypomnijmy, iż na mocy silnego prawa wielkich liczb ciąg średnich częściowych (\bar{X}_n) ciągu zmiennych losowych (X_n) i.i.d. z rozkładu $X \sim \mathcal{D}$ jest zbieżny z prawdopodobieństwem 1 do wartości oczekiwanej $\mathbb{E}[X]$ tj.

$$P\left(\lim_{n \rightarrow \infty} \bar{X}_n = \mathbb{E}[X]\right) = 1.$$

Wartość oczekiwaną $\mathbb{E}[X]$ możemy zatem przybliżyć średnią \bar{X}_n z dużej ilości próbek.

Wnioskowanie Monte Carlo pozwala nam szacować różne wielkości w tzw. hierarchicznych modelach Bayesowskich (z ang. *Bayesian hierarchical modeling*). Rozważmy jeszcze raz przykład regresji liniowej w ujęciu Bayesowskim, ale rozważmy teraz model postaci

$$\begin{aligned}\sigma^2 &\sim \mathcal{D}(\lambda) \\ \mathbf{w} &\sim \mathcal{N}(\boldsymbol{\mu}_0, \boldsymbol{\Sigma}_0) \\ y | \mathbf{w}, \sigma^2 &\sim \mathcal{N}(\mathbf{w}^\top \mathbf{x}, \sigma^2)\end{aligned},$$

gdzie $\lambda, \boldsymbol{\mu}_0, \boldsymbol{\Sigma}_0$ są pewnymi hiper-parametrami. Dla takiego modelu nie możemy w ogólności znaleźć jawnej postaci rozkładu a posteriori. Jeśli jednak umiemy generować próbki z rozkładu łącznego

$$Z \cdot p(\mathbf{w}, \sigma^2 | D) = p(D, \mathbf{w}, \sigma^2) = p(D | \mathbf{w}, \sigma^2)\pi(\mathbf{w})\pi(\sigma^2)$$

to wszystkie interesujące wielkości możemy oszacować jako odpowiednie średnie. Pozostaje pytanie w jaki sposób generować próbki ze skomplikowanych rozkładów prawdopodobieństwa, których gęstości znamy jedynie z dokładnością do stałej normalizującej. Poniżej przedstawimy dwa algorytmy próbkowania: algorytm IS oraz Metropolisa–Hastingsa będący szczególną realizacją całej rodziny algorytmów próbkowania zwanych Markov Chain Monte Carlo (MCMC).

Algorytm Importance Sampling (IS)

Założmy, iż chcemy obliczyć wartość oczekiwaną pewnej funkcji zmiennej losowej \mathbf{x} względem skomplikowanego rozkładu prawdopodobieństwa $p(\mathbf{x})$, który znamy jedynie z dokładnością do stałej normalizującej

$$p(\mathbf{x}) = \frac{1}{Z_p} \tilde{p}(\mathbf{x})$$

tj. szukamy

$$\mathbb{E}_p[f(\mathbf{x})] = \int f(\mathbf{x})p(\mathbf{x})d^n\mathbf{x}.$$

Jeśli umiemy generować próbki \mathbf{x} z innego (prostsze) rozkładu $q(\mathbf{x})$, który nazywamy rozkładem proponującym kandydatów (z ang. *proposal distribution*) to możemy zapisać

$$\begin{aligned} \mathbb{E}_p[f(\mathbf{x})] &= \int_{\mathbb{R}^n} f(\mathbf{x})p(\mathbf{x})d^n\mathbf{x} = \int_{\mathbb{R}^n} f(\mathbf{x})\frac{p(\mathbf{x})}{q(\mathbf{x})}q(\mathbf{x})d^n\mathbf{x} \\ &= \mathbb{E}_q\left[f(\mathbf{x})\frac{p(\mathbf{x})}{q(\mathbf{x})}\right] = \frac{Z_q}{Z_p}\mathbb{E}_q\left[f(\mathbf{x})\frac{\tilde{p}(\mathbf{x})}{\tilde{q}(\mathbf{x})}\right]. \end{aligned}$$

Zakładamy tutaj, iż nośnik rozkładu p zawiera się w nośniku q tj. $\text{supp } p \subseteq \text{supp } q$. Stosunek stałych Z_p/Z_q również możemy oszacować z próbek z q , gdyż mamy

$$Z_p = \int_{\mathbb{R}^n} \tilde{p}(\mathbf{x}) d^n\mathbf{x} = Z_q \int_{\mathbb{R}^n} \frac{\tilde{p}(\mathbf{x})}{\tilde{q}(\mathbf{x})} q(\mathbf{x}) d^n\mathbf{x} = Z_q \mathbb{E}_q\left[\frac{\tilde{p}(\mathbf{x})}{\tilde{q}(\mathbf{x})}\right],$$

skąd ostatecznie

$$\mathbb{E}_p[f(\mathbf{x})] = \frac{\mathbb{E}_q\left[f(\mathbf{x})\frac{\tilde{p}(\mathbf{x})}{\tilde{q}(\mathbf{x})}\right]}{\mathbb{E}_q\left[\frac{\tilde{p}(\mathbf{x})}{\tilde{q}(\mathbf{x})}\right]}.$$

Jeśli z rozkładu q wygenerowaliśmy próbki $X = \{\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_m\}$ to na mocy silnego prawa wielkich liczb mamy

$$\mathbb{E}_p[f(\mathbf{x})] \approx \frac{\sum_{i=1}^m f(\mathbf{x}_i) \frac{\tilde{p}(\mathbf{x}_i)}{\tilde{q}(\mathbf{x}_i)}}{\sum_{i=1}^m \frac{\tilde{p}(\mathbf{x}_i)}{\tilde{q}(\mathbf{x}_i)}} = \sum_{i=1}^m \lambda_i f(\mathbf{x}_i),$$

gdzie

$$\lambda_i = \frac{\tilde{p}(\mathbf{x}_i)/\tilde{q}(\mathbf{x}_i)}{\sum_{j=1}^m \tilde{p}(\mathbf{x}_j)/\tilde{q}(\mathbf{x}_j)}.$$

Algorytm Importance Sampling jest prostym algorytmem Monte Carlo, który ma jeden zasadniczy problem. W jaki sposób mamy wybrać rozkład proponujący kandydatów q ? Pewną odpowiedź na to pytanie sugeruje analiza wariancji statystyki

$$\bar{f}_m(\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_m) = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m \frac{f(\mathbf{x}_i)p(\mathbf{x}_i)}{q(\mathbf{x}_i)}$$

dla $\mathbf{x}_i \sim q$ i zakładając dla uproszczenia, iż f jest funkcją skalarną mamy

$$\text{Var}[\bar{f}_m] = \frac{1}{m} \text{Var}_q \left[f(\mathbf{x}) \frac{p(\mathbf{x})}{q(\mathbf{x})} \right] = \frac{1}{m} \int_{\mathbb{R}^n} \frac{(f(\mathbf{x})p(\mathbf{x}) - \mu_f q(\mathbf{x}))^2}{q(\mathbf{x})} d^n \mathbf{x} .$$

Chcemy oczywiście, aby wariancja była jak najmniejsza, gdyż wówczas mała liczba próbek da dobre przybliżenie wartości oczekiwanej. Rozkład proponujący kandydatów powinien być zatem proporcjonalny do $f(\mathbf{x})p(\mathbf{x})$, co może być trudne do praktycznego zrealizowania.

Algorytm Metropolisa–Hastingsa

Cała klasa algorytmów próbkowania MCMC opiera się na idei wyrażenia generowania próbek jako ewolucji pewnego łańcucha Markowa. Łańcuchem Markowa nazywamy ciąg zmiennych losowych (X_t) o wartościach w \mathbb{R}^n taki, że spełnione jest kryterium Markowa

$$\forall A \subset \mathbb{R}^n : P(X_t \in A \mid X_{t-1} = \mathbf{x}_{t-1}, \dots, X_0 = \mathbf{x}_0) = P(X_t \in A \mid X_{t-1} = \mathbf{x}_{t-1}) .$$

Elementy ciągu nazywamy stanami łańcucha Markowa. Dany łańcuch jest zadany jednoznacznie przez podanie gęstości prawdopodobieństwa przejścia łańcucha ze stanu $\mathbf{x} \rightarrow \mathbf{y}$, którą będziemy oznaczać przez $\pi(\mathbf{y} \mid \mathbf{x})$ (zakładamy, iż prawdopodobieństwo przejścia jest niezależne od chwili t – łańcuch taki nazywamy jednorodnym). Funkcja π spełnia oczywiście warunek unormowania

$$\int_{\mathbb{R}^n} \pi(\mathbf{y} \mid \mathbf{x}) d^n \mathbf{y} ,$$

istotnie prawdopodobieństwo przejścia gdziekolwiek ze stanu \mathbf{x} jest równe 1. Będziemy zakładać dodatkowo, iż $\forall \mathbf{x}, \mathbf{y} \in \mathbb{R}^n : \pi(\mathbf{y} \mid \mathbf{x}) > 0$. Rozkład $p(\mathbf{x})$ łańcucha Markowa (tj. rozkład prawdopodobieństwa z którego losujemy stan łańcucha w danej chwili t) z daną funkcją przejścia π nazwiemy rozkładem stacjonarnym tego łańcucha iff

$$p(\mathbf{y}) = \int_{\mathbb{R}^n} \pi(\mathbf{y} \mid \mathbf{x}) p(\mathbf{x}) d^n \mathbf{x} .$$

Rozkład stacjonarny danego łańcucha oznaczmy przez $p^*(\mathbf{x})$. Zauważmy, iż jeśli stan początkowy łańcucha X_0 pochodzi z rozkładu stacjonarnego p^* to każdy kolejny stan X_t również pochodzi z rozkładu stacjonarnego. Jeśli z kolei stan początkowy pochodzi z jakiegoś innego rozkładu p_0 to rozkład łańcucha w chwili t jest dany przez relację rekurencyjną

$$p_t(\mathbf{y}) = \int_{\mathbb{R}^n} \pi(\mathbf{y} \mid \mathbf{x}) p_{t-1}(\mathbf{x}) d^n \mathbf{x} , \quad \text{dla } t > 1 .$$

Rozkładem granicznym łańcucha Markowa nazwiemy granicę w sensie zbieżności punktowej

$$\lim_{t \rightarrow \infty} p_t(\mathbf{x}) .$$

Przy podanych wyżej założeniach istnieje twierdzenie, które mówi iż taki łańcuch Markowa posiada jednoznaczny rozkład stacjonarny tożsamy z rozkładem granicznym. Ponadto warunkiem wystarczającym, aby dany rozkład $p(\mathbf{x})$ był rozkładem stacjonarnym łańcucha Markowa jest

$$\forall \mathbf{x}, \mathbf{y} \in \mathbb{R}^n : \pi(\mathbf{y} | \mathbf{x})p(\mathbf{x}) = \pi(\mathbf{x} | \mathbf{y})p(\mathbf{y}) ,$$

co wynika z scałkowania powyższego równania

$$\int_{\mathbb{R}^n} \pi(\mathbf{y} | \mathbf{x})p(\mathbf{x}) d^n \mathbf{x} = \int_{\mathbb{R}^n} \pi(\mathbf{x} | \mathbf{y})p(\mathbf{y}) d^n \mathbf{x} = p(\mathbf{y}) \int_{\mathbb{R}^n} \pi(\mathbf{x} | \mathbf{y}) d^n \mathbf{x} = p(\mathbf{y}) .$$

Kryterium to nazywamy kryterium lokalnego balansu (z ang. *detailed balance condition*).

Podstawowa idea wykorzystania łańcuchów Markowa do generowania próbek ze skomplikowanego rozkładu p jest więc następująca: tworzymy łańcuch Markowa opisany powyżej, dla którego p jest rozkładem stacjonarnym, wówczas rozpoczynając w dowolnym dopuszczalnym stanie początkowym X_0 po wykonaniu dużej liczby kroków (etap ten nazywamy okresem przejściowym z ang. *burn-in period*) stan X_t (dla $t \gg 1$) tego łańcucha będzie w przybliżeniu pochodził z rozkładu granicznego p (nie jest jednak prosto stwierdzić po jak długim okresie przejściowym przybliżenie to jest wystarczająco dobre). Aby otrzymać z takiej procedury próbki prawdziwie i.i.d. każda z próbek musiałaby pochodzić z ponownego uruchomienia takiego łańcucha. Oczywiście jest to nieefektywne, więc w praktyce generujemy próbki z jednego łańcucha po prostu odrzucając pewne z nich tak aby uniknąć znaczących korelacji.

Pozostaje pytanie jak skonstruować funkcję przejścia $\pi(\mathbf{y} | \mathbf{x})$ dla danego rozkładu granicznego $p(\mathbf{x})$. Podstawową konstrukcję podaje algorytm Metropolis–Hastingsa:

1. Jako stan początkowy przyjmij dowolną dopuszczalną wartość $\mathbf{x} \leftarrow \mathbf{x}_0$.
2. Powtarzaj:
 - (a) Będąc w aktualnym stanie \mathbf{x} z prostego rozkładu proponującego kandydatów $q(\mathbf{y} | \mathbf{x})$ wylosuj kandydata \mathbf{y} na wartość łańcucha w kolejnym stanie.
 - (b) Z prawdopodobieństwem

$$r(\mathbf{y} | \mathbf{x}) = \min \left\{ 1, \frac{p(\mathbf{y})q(\mathbf{x} | \mathbf{y})}{p(\mathbf{x})q(\mathbf{y} | \mathbf{x})} \right\}$$

zaakceptuj kandydata jako nowy stan i przejdź do stanu \mathbf{y} . W przeciwnym razie pozostać w stanie \mathbf{x}

Funkcja przejścia ma zatem postać

$$\pi_{\text{MH}}(\mathbf{y} \mid \mathbf{x}) = q(\mathbf{y} \mid \mathbf{x})r(\mathbf{y} \mid \mathbf{x}) .$$

Pozostaje tylko wykazać, iż spełnione jest kryterium lokalnego balansu. Istotnie mamy

$$\begin{aligned} \pi_{\text{MH}}(\mathbf{y} \mid \mathbf{x})p(\mathbf{x}) &= \min \{q(\mathbf{y} \mid \mathbf{x})p(\mathbf{x}), q(\mathbf{x} \mid \mathbf{y})p(\mathbf{y})\} \\ \pi_{\text{MH}}(\mathbf{x} \mid \mathbf{y})p(\mathbf{y}) &= \min \{q(\mathbf{x} \mid \mathbf{y})p(\mathbf{y}), q(\mathbf{y} \mid \mathbf{x})p(\mathbf{x})\} \quad , \end{aligned}$$

skąd $\pi_{\text{MH}}(\mathbf{y} \mid \mathbf{x})p(\mathbf{x}) = \pi_{\text{MH}}(\mathbf{x} \mid \mathbf{y})p(\mathbf{y})$. Zauważmy, iż nie musimy znać $p(\mathbf{x})$ z dokładnością do stałej normalizującej, gdyż

$$\frac{p(\mathbf{y})}{p(\mathbf{x})} = \frac{\tilde{p}(\mathbf{y})/Z_p}{\tilde{p}(\mathbf{x})/Z_p} = \frac{\tilde{p}(\mathbf{y})}{\tilde{p}(\mathbf{x})} .$$