



**DEPARTAMENTO
DE COMPUTACION**

Facultad de Ciencias Exactas y Naturales - UBA

Trabajo Práctico 2

15 de julio de 2018

Métodos Numéricos
Primer Cuatrimestre de 2018

Los arboles mueren de pie

Integrante	LU	Correo electrónico
Giudice, Carlos	694/15	carlosr.giudice@gmail.com
Junqueras Juan,	804/16	junquerasjuan@gmail.com



Facultad de Ciencias Exactas y Naturales
Universidad de Buenos Aires

Ciudad Universitaria - (Pabellón I/Planta Baja)

Intendente Güiraldes 2610 - C1428EGA

Ciudad Autónoma de Buenos Aires - Rep. Argentina

Tel/Fax: (+54 +11) 4576-3300

<http://www.exactas.uba.ar>

Índice

1. Introducción	2
1.1. Evaluación	2
2. Desarrollo	3
2.1. kNN	3
2.2. PCA	3
2.3. Fotos y algoritmo Peola	3
2.4. $X^t * X$ y $X * X^t$	4
2.5. Validación cruzada	5
3. Resultados	6
3.1. Tiempo de ejecución kNN	6
3.2. Tiempo de ejecución PCA+kNN	6
3.3. Tiempo de ejecución PCA	6
3.4. K de kNN	7
3.5. K de kNN old	9
3.6. Alfa de PCA	11
3.7. Data augmentation	13
4. Conclusiones	14
5. Apéndice	15
5.1. Apéndice I: detalles de implementación	15
5.2. Apéndice II: código complementario en MATLAB	15

1. Introducción

Este trabajo práctico tiene como objetivo el desarrollo y estudio de una herramienta que permita reconocer rostros en imágenes. El algoritmo capaz de llevar esto a cabo es uno de clasificación supervisado que fue entrenado con un lote de fotografías conocido, de modo que le sea posible reconocer otras fotografías de esos rostros aprendidos que no se encuentren en la base de datos de entrenamiento.

Las imágenes de las que disponemos corresponden a cuarenta y un personas, habiendo diez imágenes diferentes por persona.

Si la imagen que entra como parámetro, es de una persona que no pertenece al grupo con que se entrenó al algoritmo, entonces éste indicará a cual de los cuarenta y un se parece más.

1.1. Evaluación

Para el estudio de esta herramienta es necesaria la evaluación de los métodos y la correcta elección de sus parámetros. Una forma de evaluación es la estimación de la correctitud de la clasificación, para lo cual es necesario conocer previamente a qué persona corresponde cada imagen. La forma de realizar esto es particionar la base de entrenamiento en dos, utilizando una parte de ella en forma completa para el entrenamiento y la restante como test, pudiendo así corroborar la clasificación realizada, al contar con el etiquetado del entrenamiento.

Sin embargo, realizar toda la experimentación sobre una única partición de la base podría resultar en una incorrecta estimación de parámetros, por ejemplo, podría dar overfitting. Por lo tanto, se implementó la técnica de *K-fold cross validation* que resulta estadísticamente más robusta.

El resultado del algoritmo final fue medido con distintas métricas (Accuracy, Curvas de precisión/recall).

2. Desarrollo

2.1. kNN

El algoritmo kNN (k Nearest Neighbours) se basa en el análisis de un conjunto de puntos del espacio para determinar a qué clase corresponde el nuevo objeto. En este caso cada imagen estará representada como un vector donde cada elemento es un píxel distinto de la misma. El conjunto de puntos elegido serán aquellas k imágenes que más cerca se encuentren de la imagen a clasificar. Se clasificará a la nueva imagen como perteneciente a la clase que mayor representantes tenga en este conjunto de puntos cercanos.

Este algoritmo puede ser sumamente costoso en cuanto al tiempo de cómputo, y si la dimensión de los puntos a clasificar es muy grande, hacer uso del mismo podría resultar impracticable. Es por esto que se implementó un método cuyo objetivo es preprocesar las imágenes para reducir la cantidad de dimensiones de las muestras, permitiendo a kNN trabajar con muestras de una menor cantidad de variables. Este método es conocido como PCA (Principal components analysis).

2.2. PCA

El método de análisis de componentes principales se encarga de cambiar de base el conjunto de datos de entrada para obtener una mejor representación de los datos, y además reduce la dimensión de cada elemento tanto como se desee. Al reducir la dimensión de un punto es claro que se pierde información sobre el mismo, pero la particularidad de este método es que, se queda con las componentes más importantes, dejando de lado las que menos información aporten (de allí su nombre). De este modo, la información que descartada es la de menor relevancia, por lo que se lo considera una buena manera de reducir el espacio de la entrada.

Es importante aclarar que el método no solamente reduce la dimensión de los datos, sino que cambia la base de los mismos. Si se utiliza el método para reducir la entrada de kNN, es necesario cambiar a la misma base la imagen a clasificar, de lo contrario estarían comparándose elementos pertenecientes a distintos espacios.

Procedimiento para el cambio de base:

1. Se define una base de datos de entrenamiento (para kNN) como el conjunto $= \{x_i : i = 1, \dots, n\}$.
2. Sea $\mu = (x_1 + \dots + x_n)/n$ el promedio de las imágenes de $D = \{x_i : i = 1, \dots, n\}$ tal que $x_i \in R^m$. Definimos $X \in R^{n \times m}$ como la matriz que contiene en la i -ésima fila al vector $(x_i - \mu)^t / \sqrt{n-1}$. La matriz de covarianza de la muestra X se define como $M = X^t X$.
3. Se calcula X y con ella M .
4. Se calculan los autovectores de M mediante el método de las potencias, con deflación. Como cada iteración en la que calculamos el autovector de la matriz en cuestión, este está asociado al autovalor de máximo módulo, los autovectores que habremos calculado se encontrarán ordenados por relevancia. De esta manera se calculan tan solo α autovectores, con $1 \leq \alpha \leq n$, siendo α la dimensión a la que se quiere reducir las imágenes.
5. Se contruye la matriz V con los autovectores calculados previamente, dispuestos como columnas. V es la matriz de cambio de base.
6. Por último, se reduce la dimensión de X cambiando su base. El resultado final es $V^t X^t$ que contiene la misma cantidad de imágenes pero expresadas en otra base, y en lugar de tener dimensión n , cada una tiene dimensión α .

Es interesante notar que una vez hecho el cambio de base de las imágenes, éstas representan a las imágenes pero si se trata de graficarlas se obtendrá algo muy distinto a lo que era anteriormente y no podrá visualizarse nada en concreto. Solo volviendo a la base original sería posible, pero ya se habrá perdido mucha información por lo que probablemente sea difícil encontrarlo útil.

2.3. Fotos y algoritmo Peola

```
[H] img,  $\alpha$ ,  $\sigma$  La imagen manipulada Deformación Generamos 2 matrices de desplazamiento aleatorias
dx  $\leftarrow$  rand(size(img))
dy  $\leftarrow$  rand(size(img))
Suavizamos con un filtro gausseano la aleatoriedad de la matriz fdx  $\leftarrow \alpha * \text{imgaussfilt}(dx, \sigma)$ 
fdy  $\leftarrow \alpha * \text{imgaussfilt}(dy, \sigma)$ 
```

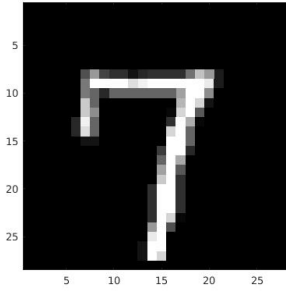


Figura 1: Original

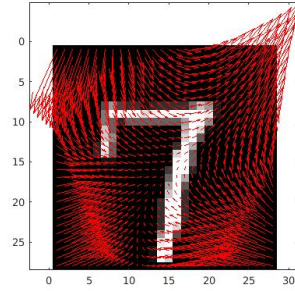


Figura 2: Vectores de desplazamiento

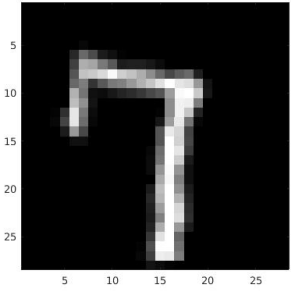


Figura 3: Resultado

Aplica el desplazamiento aleatorio usando la interpolación de griddata $res \leftarrow \text{griddata}(fdx, fdy, img)$

Como se puede observar, el dígito resultante es distinto al original pero al ojo humano sigue siendo el mismo dígito. Con este método generamos un nuevo data-set aplicando esta función a cada imagen y así ahora tenemos el doble de datos 84000 dígitos.

Además de notar que los trazos no son perfectos, la orientación y rotación de los dígitos no es siempre la misma. Quisimos llevar al extremo aumentar los datos y aplicamos una segunda transformación a los dígitos. Para ello aplicamos una rotación aleatoria a cada dígito, usando la función de matlab para rotar imágenes `imrotate`, generamos un número aleatorio entre un cierto rango que le pasamos por parámetro como el ángulo. 30 grados nos pareció razonable ya que si se le aplica más hay dígitos que no se verían beneficiados.

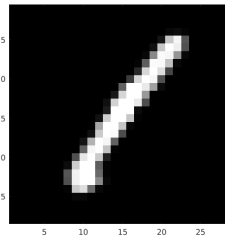


Figura 4: Dígito Original 1

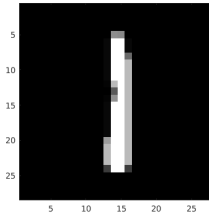


Figura 5: Dígito Original 2

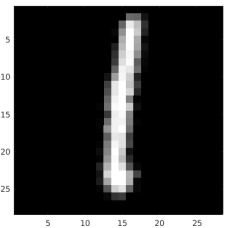


Figura 6: Dígito 1 rotado 30° sentido horario

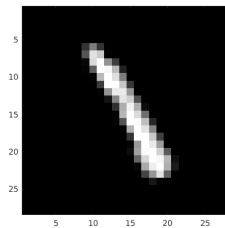


Figura 7: Dígito 2 rotado 30° sentido horario

2.4. $X^t * X$ y $X * X^t$

El método de la potencia con deflación se utiliza para obtener tanto los autovectores como los valores asociados de una matriz. Éste método es particularmente susceptible al tamaño de la matriz que entra como parámetro. Al ser $X \in R^{n \times m}$ (con $m \gg n$), la matriz M acarrea un gran costo temporal para el cómputo del método de la potencia con deflación. Por lo que definimos la matriz $\hat{M} \in R^{n \times n}$ como $\hat{M} = X * X^t$. Como podemos ver, \hat{M} depende de la cantidad de imágenes de training set (que tiene como cota superior 410), por lo que será mucho más chica que M . Propondremos un método que utiliza los autovectores y autovalores de \hat{M} (cuyo cálculo implica menor costo temporal)

para obtener los de M .

Primero veamos que relación hay entre los autovectores y los autovalores de $X^t * X$ y $X * X^t$:

$$\begin{aligned}
& \text{Sea } X \in R^{n \times m}, \hat{M} = XX^t \text{ y } M = X^t X. \\
& \text{Sea } v_i \text{ el autovector de } \hat{M} \text{ asociado a } \lambda_i, \text{ para } i = 1, \dots, n. \\
& \Rightarrow \hat{M}v_i = \lambda_i v_i, \text{ para } i = 1, \dots, n. \text{ Por definición de autovalor y autovector.} \\
& \Rightarrow XX^t v_i = \lambda_i v_i. \text{ Porque } \hat{M} = XX^t. \\
& \Rightarrow X^t XX^t v_i = \lambda_i X^t v_i. \text{ Multiplico a izquierda por } X^t. \\
& \quad \text{Defino } u_i = X^t v_i \\
& \quad \Rightarrow X^t X u_i = \lambda_i u_i \\
& \quad \text{Como } M = X^t X, \\
& \quad \Rightarrow M u_i = \lambda_i u_i \\
& u_i \text{ es el autovector de } M \text{ asociado al autovalor } \lambda_i
\end{aligned}$$

Procedimiento para obtener los autovectores y autovalores de M a partir de \hat{M} utilizando la definición de u_i que acabamos de formular:

1. Utilizando el método de la potencia con deflación se calculan los autovectores y autovalores de $\hat{M} = X * X^t$ (v_i y λ_i , para $i = 1, \dots, n$).
2. Se crea una matriz $V \in R^{n \times n}$ y en sus columnas se colocan los autovectores v_i de \hat{M} en el orden que fueron apareciendo (el método de la potencia con deflación devuelve los autovectores ordenados por módulo y sus autovectores correspondientes). Se guardan aparte los n autovalores λ_i , $i = 1, \dots, n$.
3. Se calcula $U = X^t * V$, en cada columna U tendrá $u_i = X^t * v_i$ para $i = 1, \dots, n$.
4. Recorriendo las columnas de U se recuperan los autovectores u_i de M .

2.5. Validación cruzada

Dado que necesitamos conocer previamente a qué persona corresponde una imagen para poder estimar la corrección de la clasificación, una alternativa es particionar la base de entrenamiento en dos, utilizando una parte de ella en forma completa para el entrenamiento y la restante como test, pudiendo así corroborar la clasificación realizada, al contar con el etiquetado del entrenamiento. Sin embargo, realizar toda la experimentación sobre una única partición de la base podría resultar en una incorrecta estimación de parámetros, dando lugar al conocido problema de overfitting. Por lo tanto, se estudiará la técnica de *crossvalidation*, en particular el *K-foldcrossvalidation*1, para realizar una estimación de los parámetros de los métodos que resulte estadísticamente más robusta.

La validación cruzada *K-fold* consiste en particionar la base de entrenamiento en K partes del mismo tamaño. Luego se realiza K iteraciones, cada una de ellas reteniendo uno de los conjuntos para validación y utilizando los restantes $K - 1$ s para entrenamiento. Este método usualmente permite tomar las particiones sin cuidado alguno, pero en nuestro caso de uso tal cosa no es conveniente. Esto se debe a que en nuestra base de entrenamiento cada persona está representada por diez imágenes, con lo cual dividir las muestras de forma aleatoria puede desbalancear que tan representadas están algunas personas en el training set. Esto puede significar que el algoritmo se entrena poco para algunas personas y mucho para otras. Yendo más lejos, este desbalance en el train set siempre tiene su contraparte en el test set, impactando de forma negativa las métricas. Para resolver este problema, se propuso el uso de un *k-fold* que respete las proporciones de imágenes de cada persona. Como el test set siempre tiene que tener la misma cantidad de fotos para cada persona. Como nuestro dataset cuenta con cuarenta y un personas diferentes, la cantidad de rows del test set será un múltiplo de ese número. Esto implica que k será múltiplo de diez. Se realizó un shuffle de las imágenes y se eligieron los folds respetando las proporciones mencionadas.

3. Resultados

Uno de los objetivos de la experimentación de este trabajo era encontrar los mejores parámetros para los métodos, es decir, los parámetros para los cuales los algoritmos proporcionaban mejores resultados. Para determinar la calidad de los resultados obtenidos (cuáles eran los mejores) se tuvo en cuenta distintas métricas, que ayudaron a determinar esto mismo:

- Accuracy
- F1-Score

Los resultados obtenidos fueron analizados en términos de estas métricas aplicando validación cruzada K -fold, variando el K sobre la base de entrenamiento.

Los parámetros k (cantidad de vecinos en kNN , no confundir con K de K -fold) y α (dimensión a la cual se reduce cada imagen con PCA) fueron variándose como se expone en las páginas siguientes.

Además de las métricas mencionadas, se tuvo en cuenta el tiempo de cómputo para las distintas entradas.

3.1. Tiempo de ejecución kNN

Dado que el costo temporal de kNN no depende del parámetro k , lo que nos interesa es entender el costo fijo por predicción. En un dataset de 205 imágenes reducidas, el costo promedio de clasificación de una imagen fue de 0.00042. Comparamos ese resultado con el costo promedio para la misma cantidad de imágenes de tamaño completo y el resultado fue 0.11738, varios órdenes de magnitud mayor.

3.2. Tiempo de ejecución PCA+kNN

Para evaluar el costo temporal de las predicciones de kNN al utilizar PCA , es necesario tener en cuenta el costo de la transformación característica (tc), que se realiza a cada imagen a predecir para poder compararla con las imágenes de entrenamiento transformadas gracias al PCA . Otro factor a tener en cuenta es que el α de PCA define la dimensión de las imágenes que compara el kNN , esto impacta directamente a la cantidad de operaciones necesarias y consecuentemente al tiempo de cómputo.

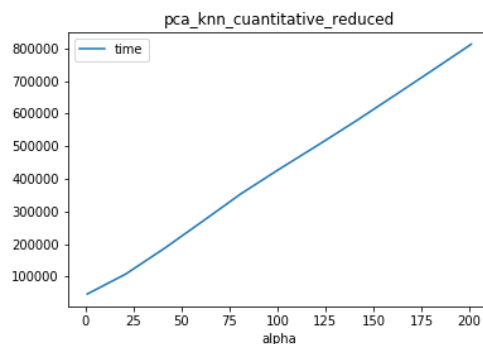


Figura 8: Costo temporal de tc + predicción de kNN

3.3. Tiempo de ejecución PCA

Con el objetivo de entender el costo de calcular una matriz de covarianzas para una muestra X , probamos con diferentes cantidades de imágenes reducidas y con diferentes valores del α de PCA .

Para visualizar los resultados de los experimentos para cada X , se creó un gráfico donde la variable independiente es el α y la variable dependiente es el tiempo de cómputo.

En los gráficos Observamos que el tiempo de cómputo se comporta de forma lineal en relación al α para distintos segmentos de α , pero la pendiente es discontinua. No se pudo encontrar una causa evidente a esta falta de continuidad.// Notar que el método descrito en la sección *Desarrollo* para obtener la matriz de covarianzas M a partir de \hat{M} , no pudo ser implementado completamente. Se estima que éste método reduciría significativamente el cálculo de la matriz de covarianza M (que es lo que más tiempo consume de todo el programa).

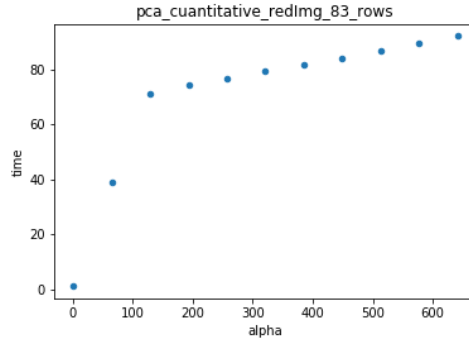


Figura 10: Costo temporal de PCA para ochenta y tres imágenes reducidas

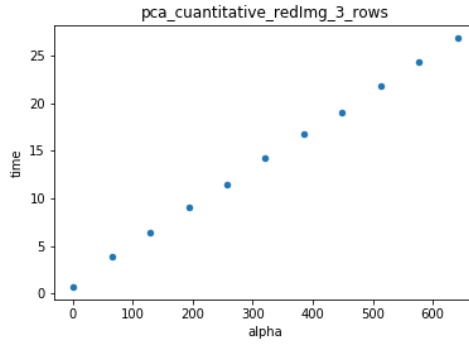


Figura 9: Costo temporal de PCA para tres imágenes reducidas

3.4. K de kNN

Utilizamos las imagenes de tamaño completo, siempre que pudimos, porque dispusimos de acceso a un gran poder de cómputo. Llamamos k a la constante que define cuantos vecinos se tienen en cuenta a la hora de decidir la categoría de la muestra a clasificar. Los valores probados para k fueron 1, 3, 8, 10, 15 y 25. Se observó consistentemente que todas las métricas decrecen a medida que se incrementa el valor de k . Siendo $k = 1$ el valor óptimo. La cantidad de imágenes tomadas de cada persona por nuestro $k - Fold$ es dos, suponemos que es por ésto que en el siguiente gráfico recall, accuracy, precision y F1 se .°verlapean” (aparecen una arriba de otra), por eso parece que se estuviese graficando únicamente F1.

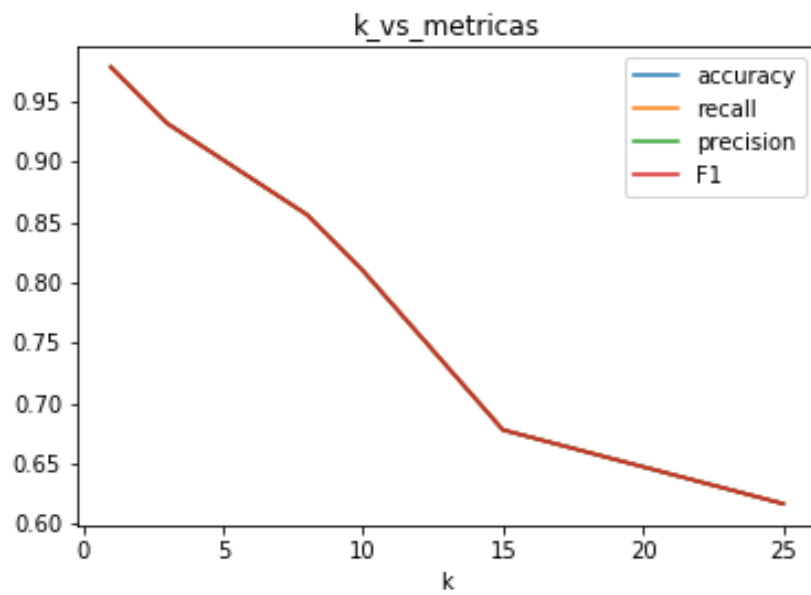


Figura 11: Metricas para distintos valores de k

La diferencia en la calidad de las predicciones tambien puede observarse visualizando matrices de confusión.



Figura 12: Metricas para distintos valores de k

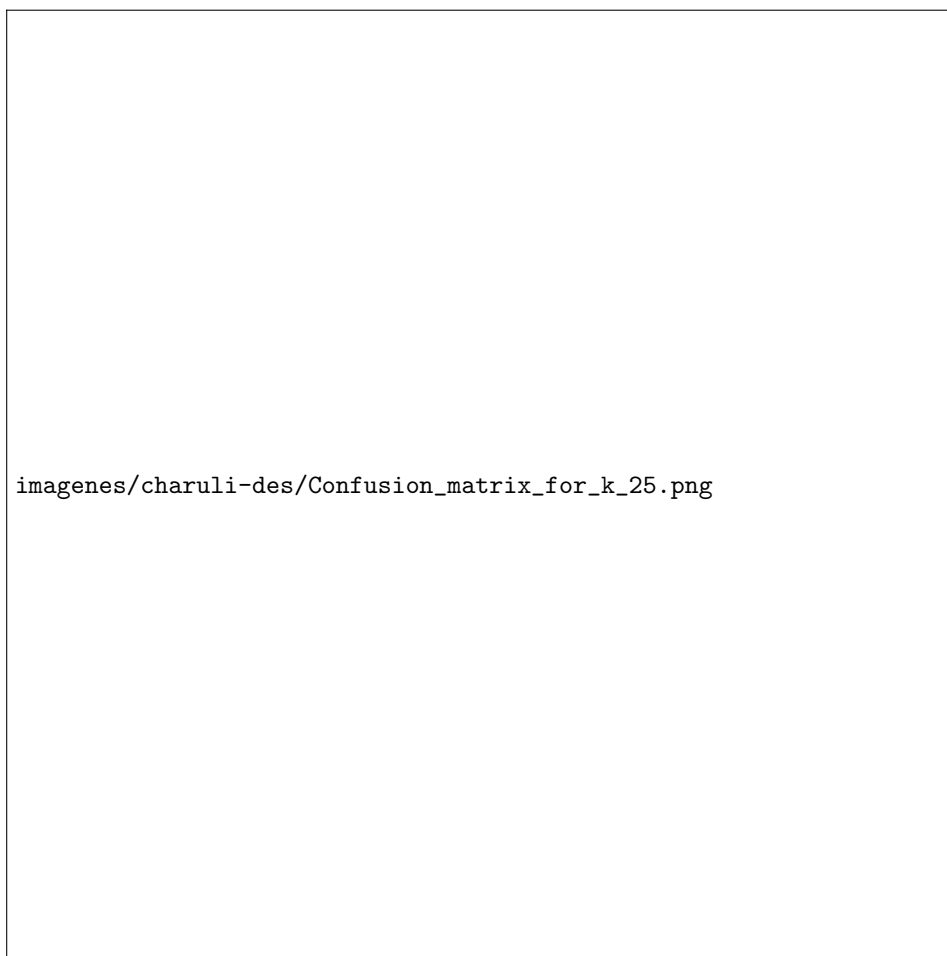


Figura 13: Metricas para distintos valores de k

4. Discusión

5. Conclusiones

En base a lo explicado en las secciones anteriores de este trabajo, pudimos concluir que los valores que mejor funcionan para nuestro algoritmo son 5 para kNN y 30 para el alfa de PCA. Más aún, podemos decir con confianza que el uso de análisis de componentes principales mejoró la calidad y el tiempo de ejecución de forma drástica para el set de datos provisto. No obstante, para que esto funcione de forma óptima se necesita un set de datos amplio como el utilizado para este trabajo. Además, encontramos que el método tiene un límite de precisión que no pudimos superar a pesar de realizar distintas técnicas y experimentaciones, si bien el mismo es elevado (casi 98 % de Accuracy).

En resumen, consideramos que este algoritmo es muy útil en casos donde una exactitud del 100 % no es indispensable, dada la calidad de los resultados y su sencilla implementación. Hacemos esta aclaración ya que este mismo algoritmo puede ser y es comunmente utilizado para múltiples problemas de clasificación, donde los datos de entrada son multidimensionales.

6. Apéndice

6.1. Apéndice I: detalles de implementación

Para poder soportar la posible necesidad de matrices más eficientes en memoria, creamos una clase `Matrix` con múltiples implementaciones. La misma tiene métodos para cada operación que consideramos necesaria, y algunas otras utilidades que utilizamos en el Trabajo Práctico 1. Por otro lado, implementamos una matriz completa (con vectores de la biblioteca estándar de C++), una matriz dispersa (usando mapas), y otras versiones más específicas.

Para evitar complicaciones con el manejo de punteros y el polimorfismo, utilizamos `std::shared_ptr` de C++11, que se encarga de borrar las matrices que no necesitamos por nosotros.

Sin embargo, luego nos dimos cuenta que los casos de uso de este TP no requieren varias versiones específicas como si las requería tal vez el TP anterior. La implementación sigue incluida, pero solo se usa la versión completa de la matriz (denominada `FullMatrix`).

Otro elemento que dejamos en la implementación pero no se utiliza fueron unos pseudo-iteradores para las imágenes que recorren archivos en lugar de vectores en memoria. El mismo no se usa porque es muy poco eficiente (ya que lee múltiples veces un archivo en disco), y luego de medir el consumo de memoria lo consideramos innecesario.

Por otro lado, decidimos abstraer el entrenamiento y el reconocimiento de las imágenes en una clase común, a modo de intercambiar implementaciones rápidamente y por parámetros. Hoy en día nuestro TP solo cuenta con 2 implementaciones: kNN y kNN + PCA, pero podrían arregarse otras variaciones a futuro.

6.2. Apéndice II: código complementario en MATLAB

Además del código con el reconocimiento de dígitos implementado en C++, incluimos en la entrega algunos scripts de MATLAB que nos resultaron útiles durante la experimentación. Los mismos incluyen comentarios explicando su funcionalidad, pero todos están relacionados a los datos con los que experimentamos (con algunos métodos para probar incrementando el set de entrenamiento) y los resultados de dichos experimentos (validación cruzada, F1 score, etc).