

TRƯỜNG ĐẠI HỌC KHOA HỌC TỰ NHIÊN  
KHOA CÔNG NGHỆ THÔNG TIN

Nguyễn Duy Vũ  
Nguyễn Chiêu Bản

HỆ THỐNG GỢI Ý SẢN PHẨM  
DỰA TRÊN MÔ HÌNH HỌC NHÂN QUẢ

KHÓA LUẬN ĐẠI HỌC KHOA HỌC MÁY TÍNH

Tp. Hồ Chí Minh, tháng 06/2022

TRƯỜNG ĐẠI HỌC KHOA HỌC TỰ NHIÊN  
KHOA CÔNG NGHỆ THÔNG TIN

Nguyễn Duy Vũ - 18120264  
Nguyễn Chiêu Bản - 18120283

**HỆ THỐNG GỢI Ý SẢN PHẨM  
DỰA TRÊN MÔ HÌNH HỌC NHÂN QUẢ**

KHÓA LUẬN ĐẠI HỌC KHOA HỌC MÁY TÍNH  
**NGƯỜI HƯỚNG DẪN**

Th.S. Trần Trung Kiên

TS. Nguyễn Ngọc Thảo

Tp. Hồ Chí Minh, tháng 06/2022

# Lời cảm ơn

Tôi xin chân thành cảm ơn ...

# Mục lục

Lời cảm ơn	i
Đề cương chi tiết	ii
Mục lục	ii
Tóm tắt	v
<b>1 Giới thiệu</b>	<b>1</b>
1.1 Phát biểu và ý nghĩa của bài toán . . . . .	1
1.2 Thách thức của bài toán . . . . .	2
1.3 Tổng quan . . . . .	8
<b>2 Kiến thức nền tảng</b>	<b>9</b>
2.1 “Matrix factorization” . . . . .	9
2.1.1 Hàm dự đoán của “Matrix factorization” . . . . .	10
2.1.2 Tìm các tham số của hàm dự đoán của “Matrix Factorization” . . . . .	12
2.2 “Logistic regression” . . . . .	12
2.2.1 Hàm “sigmoid” . . . . .	13
2.2.2 Hàm dự đoán của “Logistic regression” . . . . .	13
2.2.3 Tìm các tham số của hàm dự đoán của “Logistic regression” . . . . .	14
2.3 “Naive bayes” . . . . .	16

2.3.1	Định lý “Bayes” . . . . .	16
2.3.2	Hàm dự đoán của “Naive bayes” . . . . .	16
2.3.3	Tìm các xác suất của hàm dự đoán của “Naive Bayes”	17
2.4	“Gradient descent” . . . . .	18
2.4.1	Ý tưởng chính . . . . .	19
<b>3</b>	<b>Phương pháp tìm hiểu</b>	<b>22</b>
3.1	Xem hệ thống gợi ý như một điều trị . . . . .	22
3.2	“Inverse propensity scoring” (IPS) . . . . .	25
3.3	“Self normalized inverse propensity scoring” (SNIPS) . . .	28
3.4	Ước lượng ma trận xu hướng . . . . .	28
3.4.1	Ước lượng ma trận xu hướng thông qua Naive bayes	29
3.4.2	Ước lượng ma trận xu hướng thông qua Logistic re- gression . . . . .	30
3.5	Phân rã ma trận kết hợp với IPS . . . . .	31
<b>4</b>	<b>Các kết quả thí nghiệm</b>	<b>33</b>
4.1	Các thiết lập thí nghiệm . . . . .	33
4.2	Đánh giá hiệu suất trên dữ liệu thế giới thực . . . . .	34
4.3	Dữ liệu thiên lệch ảnh hưởng đến việc đánh giá như thế nào?	35
<b>5</b>	<b>Tổng kết và hướng phát triển</b>	<b>36</b>
	<b>Tài liệu tham khảo</b>	<b>37</b>

# Danh sách hình

1.1	Cách thức hoạt động của hệ thống đề xuất sản phẩm . . . .	3
1.2	Phân phối điểm đánh giá sản phẩm, được thu thập bằng cách cho người dùng đánh giá các sản phẩm ngẫu nhiên và cho người dùng đánh giá các sản phẩm tự lựa chọn. . . . .	4
1.3	Ví dụ minh họa tác động của thiên lệch dữ liệu. $Y$ là những điểm đánh giá thật của dữ liệu, minh họa bằng những con số nằm bên dưới ma trận. $O$ là những điểm đánh giá quan sát được, minh họa bằng những điểm đánh giá của người dùng cho các sản phẩm. . . . .	5
1.4	Các cách dự đoán $\hat{Y}_1$ và $\hat{Y}_2$ trên tập dữ liệu . . . . .	6
1.5	Đánh giá 2 mô hình dự đoán $\hat{Y}_1, \hat{Y}_2$ dựa trên các mẫu quan sát được . . . . .	7
2.1	Matrix Factorization. Ma trận tương tác $R$ sẽ được phân rã thành ma trận đại diện cho người dùng $P$ và đại diện cho sản phẩm $Q$ . . . . .	10
2.2	Đồ thị hàm số số “Sigmoid” (hình vẽ được lấy từ bài giảng của GS. Andrew Ng trong khóa học "Machine Learning" ở trang coursera.org) . . . . .	13
2.3	Minh họa quá trình tìm điểm cực tiểu của hàm chi phi thông qua thuật toán “Gradient descent”. . . . .	20

# Danh sách bảng

4.1	Hiệu suất trên 2 tập dữ liệu Yahoo và Coat . . . . .	35
-----	--	----

# Chương 1

## Giới thiệu

*Trong chương này, đầu tiên nhóm chúng em phát biểu về bài toán đề xuất sản phẩm cũng như là ý nghĩa của nó đối với cuộc sống hiện nay. Sau đó, nhóm chúng em trình bày về vấn đề thiên lệch dữ liệu, một thách thức lớn của bài toán đề xuất sản phẩm. Từ đó dẫn đến phương pháp nhóm chúng em tìm hiểu “Inverse propensity scoring” (IPS) để khắc phục vấn đề thiên lệch dữ liệu này. Ngoài ra, ở cuối chương nhóm chúng em sẽ trình bày về cách tổ chức của khóa luận.*

### 1.1 Phát biểu và ý nghĩa của bài toán

Ngày nay, các loại sản phẩm phục vụ cho đời sống con người được sinh ra ngày một nhiều. Điều này tạo nên thách thức cho người dùng là làm thế nào để có thể tìm thấy được các sản phẩm phù hợp với bản thân giữa một lượng sản phẩm khổng lồ như vậy. Do đó hệ thống đề xuất sản phẩm đã ra đời nhằm mục đích hỗ trợ cho người dùng trong quá trình tìm kiếm nội dung phù hợp cho bản thân..

Các hệ thống đề xuất sản phẩm giúp cho trải nghiệm của người dùng được cá nhân hóa, giúp tiết kiệm thời gian cho người dùng trong việc lựa chọn sản phẩm. Mặt khác, đối với các công ty nó còn tăng cao lợi thế cạnh tranh, kích thích nhu cầu mua sắm của người dùng bằng các gợi ý



sản phẩm. Có thể kể đến các hệ thống đề xuất sản phẩm nổi tiếng như: hệ thống đề xuất phim của Netflix, hay hệ thống đề xuất video của Youtube, hệ thống đề xuất nhạc của Spotify và nhiều loại hệ thống đề xuất khác nữa.

Bài toán hệ thống đề xuất sản phẩm sẽ được phát biểu như sau (hình 1.1 minh hoạ về cách thức hoạt động của hệ thống đề xuất phim):

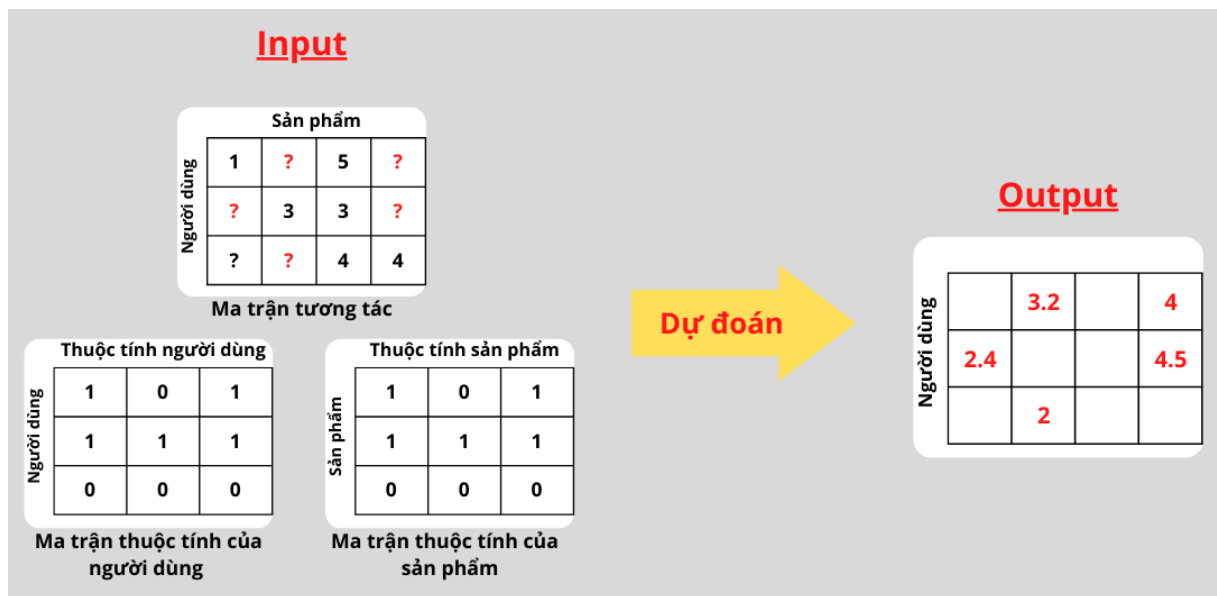
- Đầu vào là dữ liệu về điểm đánh giá của các người dùng đối với các sản phẩm trong hệ thống; dữ liệu này sẽ được đưa vào mô hình dưới dạng một ma trận tương tác thưa với mỗi dòng là các đánh giá của người dùng cho các sản phẩm. Ngoài ra, còn có thể có thêm dữ liệu về thông tin của mỗi người dùng và mỗi sản phẩm; dữ liệu này được đưa vào mô hình dưới dạng 2 ma trận thuộc tính của người dùng và sản phẩm, các điểm dữ liệu trong ma trận thuộc tính sẽ được tiền xử lý thành dạng số.
- Yêu cầu: đề xuất các sản phẩm trong hệ thống mà phù hợp với sở thích của mỗi người dùng (để có thể đề xuất thì một cách làm phổ biến là dự đoán điểm đánh giá của người dùng đối với các sản phẩm mà người dùng chưa đánh giá).

Cụ thể hơn, đầu vào của hệ thống sẽ là ma trận tương tác (chứa điểm đánh giá của các người dùng cho

Trong phạm vi đề tài của khóa luận nhóm chúng em sẽ tiến hành xử lý trên dữ liệu explicit feedback. Explicit feedback là dữ liệu cho biết rõ ràng mức độ ưa thích của người dùng đối với sản phẩm, chẳng hạn như điểm đánh giá của người dùng cho 1 bộ phim từ 1 đến 5.

## 1.2 Thách thức của bài toán

Để huấn luyện được mô hình có thể đề xuất chính xác tất cả các sản phẩm cho người dùng, ta cần một bộ dữ liệu đầy đủ bao gồm đánh giá

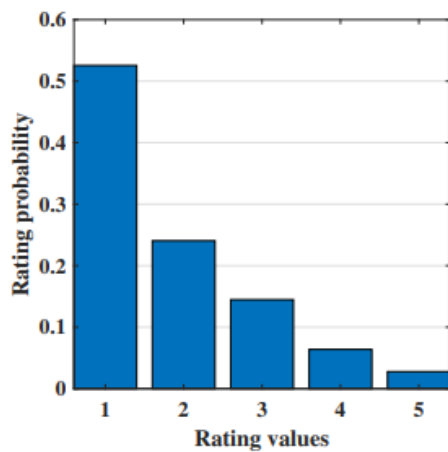


Hình 1.1: Cách thức hoạt động của hệ thống đề xuất sản phẩm

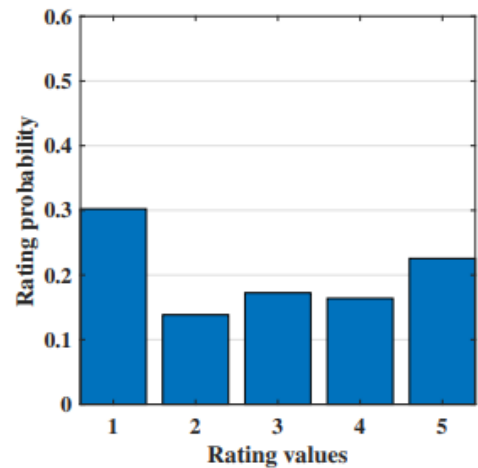
của tất cả người dùng cho tất cả sản phẩm. Tuy nhiên dữ liệu này không thể có được trong thực tế, do người dùng không thể nào xem và đánh giá tất cả các sản phẩm trong hệ thống. Vì vậy để mô hình có thể huấn luyện được tốt nhất ta cần bộ dữ liệu quan sát được phải được phát sinh từ phân phối đều của bộ dữ liệu đầy đủ này, vì bộ dữ liệu quan sát được này sẽ đại diện cho bộ dữ liệu đầy đủ và nó được gọi là dữ liệu không bị thiên lệch.

Dữ liệu quan sát được trong bài toán đề xuất sản phẩm thường bị gặp vấn đề lớn về thiên lệch dữ liệu. Thiên lệch dữ liệu là dữ liệu quan sát được không được phát sinh từ phân phối đều, do đó nó không đại diện được cho bộ dữ liệu đầy đủ. Bắt nguồn từ 2 nguyên nhân chính trong việc thu thập dữ liệu sau:

- Do người dùng tự chọn các bộ phim để đánh giá, thay vì dựa trên việc người dùng đánh giá một tập các sản phẩm ngẫu nhiên. Việc người dùng đánh giá trên một tập các sản phẩm được đề xuất ngẫu nhiên sẽ đảm bảo dữ liệu thu được được phát sinh từ phân phối đều, giúp cho dữ liệu thu được có thể đại diện được cho tập dữ liệu đầy đủ. Một kết quả nghiên cứu của tác giả Marlin và các cộng sự [3] đã cho thấy tác động rõ ràng của thiên lệch dữ liệu. Họ đã tiến hành



(a) Các sản phẩm được chọn ngẫu nhiên.



(b) Các sản phẩm được chọn do người dùng tự lựa chọn.

Hình 1.2: Phân phối điểm đánh giá sản phẩm, được thu thập bằng cách cho người dùng đánh giá các sản phẩm ngẫu nhiên và cho người dùng đánh giá các sản phẩm tự lựa chọn.

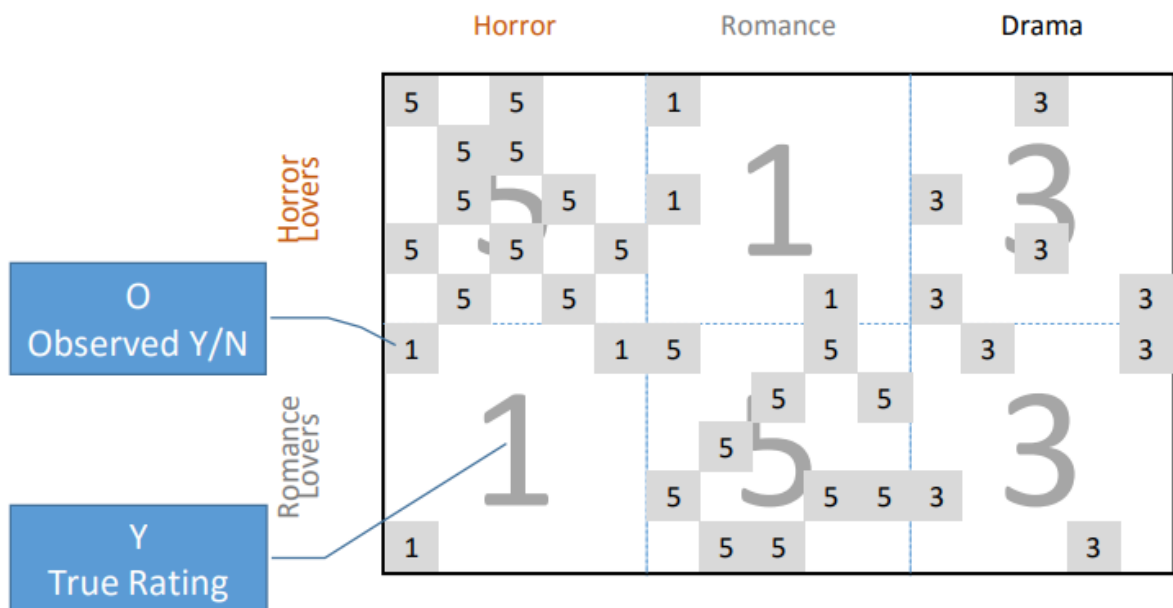
một cuộc khảo sát người dùng để thu thập dữ liệu điểm đánh giá của người dùng đối với một số sản phẩm được lựa chọn ngẫu nhiên, để so sánh với các sản phẩm do người dùng tự lựa chọn. Hình 1.2 cho thấy rõ sự khác nhau trong phân phối dữ liệu của việc lựa chọn ngẫu nhiên và do người dùng đánh giá và đưa ra 2 phát hiện: 1) người dùng có xu hướng chọn và đánh giá các mặt hàng họ thích; và 2) người dùng có nhiều khả năng xếp hạng các mặt hàng đặc biệt xấu hoặc đặc biệt tốt.

- Do hệ thống đề xuất chỉ chọn các bộ phim nào đó để hiển thị cho người dùng, trong trường hợp hệ thống đề xuất sản phẩm đã triển khai từ trước. Với tác động của hệ thống đề xuất như vậy, người dùng chỉ có thể xem và đánh giá trên các bộ phim được hiển thị, điều này làm cho dữ liệu thu thập được chỉ tập trung vào một vài loại sản phẩm nào đó, không đại diện cho toàn bộ dữ liệu.

Để hiểu rõ hơn về vấn đề thiên lệch dữ liệu ta sẽ xem xét một ví dụ nhỏ trong hệ thống đề xuất phim, minh họa tác động của thiên lệch dữ liệu có

thể gây ra cho việc đánh giá mô hình. Hình 1.3 minh họa cho thí nghiệm của ta trong đó:

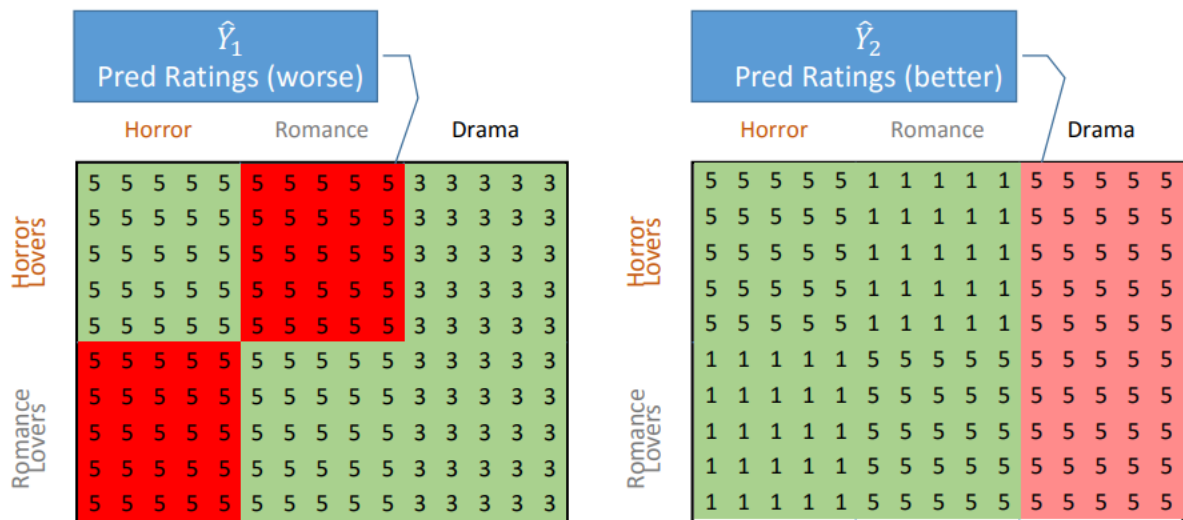
- Ma trận  $Y$  là ma trận đầy đủ chứa đánh giá của tất cả người dùng đối với tất cả các sản phẩm, trong ma trận này bao gồm 2 nhóm nhỏ: 1) những người dùng yêu thích phim kinh dị, họ sẽ đánh giá 5 điểm cho tất cả các phim kinh dị và 1 điểm cho tất cả các phim lãng mạn mà họ đã xem; nhóm trái ngược 2) những người dùng yêu thích phim lãng mạn, họ sẽ đánh giá 1 điểm cho tất cả các phim kinh dị và 5 điểm cho tất cả các phim lãng mạn mà họ đã xem; và cả 2 nhóm người dùng đều đánh giá cho thể loại phim kịch là 3.
- Ma trận  $O$  là ma trận nhị phân chứa 2 giá trị 0 và 1, đại diện cho những sản phẩm người dùng đã đánh giá trong hệ thống,  $[O_{u,i} = 1] \Leftrightarrow [Y_{u,i} \text{ được quan sát}]$ .



Hình 1.3: Ví dụ minh họa tác động của thiên lệch dữ liệu.  $Y$  là những điểm đánh giá thật của dữ liệu, minh họa bằng những con số nằm bên dưới ma trận.  $O$  là những điểm đánh giá quan sát được, minh họa bằng những điểm đánh giá của người dùng cho các sản phẩm.

Xét 2 cách dự đoán  $\hat{Y}_1$  và  $\hat{Y}_2$  sẽ được dùng để dự đoán giá trị cho các điểm đánh giá chưa quan sát được. Hình 1.4 sẽ minh họa cách 2 mô hình dự đoán như sau:

- Ở cách dự đoán  $\hat{Y}_1$ , những điểm đánh giá có giá trị thật là 1 sẽ được dự đoán là 5, các điểm đánh giá có giá trị thật là 3 và 5 sẽ được dự đoán đúng giá trị.
- Ở cách dự đoán  $\hat{Y}_2$ , những điểm đánh giá có giá trị thật là 3 sẽ được dự đoán là 5, các điểm đánh giá có giá trị thật là 3 và 5 sẽ được dự đoán đúng giá trị.



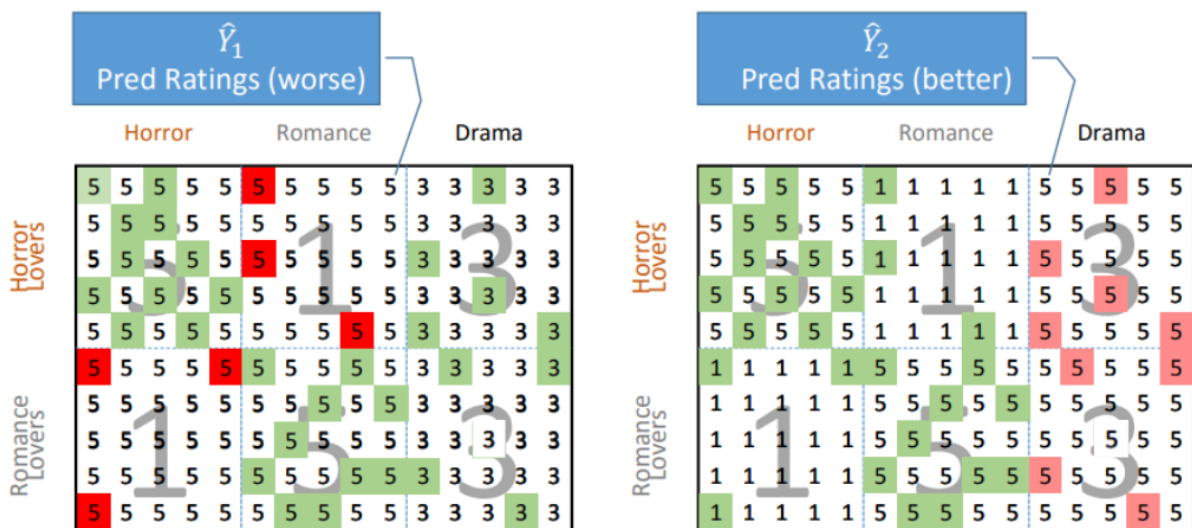
Hình 1.4: Các cách dự đoán  $\hat{Y}_1$  và  $\hat{Y}_2$  trên tập dữ liệu

Nếu chúng ta có thể quan sát toàn bộ dữ liệu như trong hình 1.4, ta có thể thấy với cách dự đoán  $\hat{Y}_1$  khi giá trị thật là 1 nhưng dự đoán là 5 thì độ lỗi của nó rất lớn. Khi so với cách dự đoán  $\hat{Y}_2$  khi giá trị thật là 3 và dự đoán là 5 có độ lỗi không quá nghiêm trọng như cách dự đoán  $\hat{Y}_1$ .

Để đánh giá một cách dự đoán có tốt hay không, ta sẽ tiến hành đánh giá độ lỗi trên tập dữ liệu quan sát được. Tuy nhiên dữ liệu quan sát được ở đây lại không được phát sinh từ phân phối đều do đó nó có sự thiên lệch, cụ thể hơn là những điểm đánh giá là 1 xuất hiện ít hơn những điểm đánh

giá là 3 (minh họa ở hình 1.5); điều này bắt nguồn từ việc người dùng tự lựa chọn các bộ phim họ thích để đánh giá.

Khi đánh giá cách dự đoán nào là tốt trên tập dữ liệu quan sát được bị thiên lệch này, ta sẽ cho rằng dự đoán  $\hat{Y}_1$  tốt hơn  $\hat{Y}_2$ . Vì theo cách dự đoán  $\hat{Y}_1$  những điểm có độ lỗi lớn (điểm đánh giá thật là 1 nhưng dự đoán là 5) xuất hiện rất ít trong bộ dữ liệu quan sát được; trong khi đó theo cách dự đoán  $\hat{Y}_2$  những điểm có độ lỗi nhỏ hơn (điểm đánh giá thật là 3 nhưng dự đoán là 5) xuất hiện nhiều hơn trong bộ dữ liệu quan sát được; điều này làm cho độ lỗi của cách dự đoán  $\hat{Y}_1$  thấp hơn cách dự đoán  $\hat{Y}_2$  mặc dù cách dự đoán  $\hat{Y}_1$  tệ hơn.



Hình 1.5: Đánh giá 2 mô hình dự đoán  $\hat{Y}_1$ ,  $\hat{Y}_2$  dựa trên các mẫu quan sát được

Để khắc phục vấn đề thiên lệch dữ liệu tác giả Tobias Schnabel và các cộng sự [4] trong bài báo “Recommendations as Treatments: Debiasing Learning and Evaluation” tại hội nghị “ICML 2016”, đã đề xuất việc áp dụng phương pháp “Inverse propensity scoring” (IPS) vào quá trình huấn luyện và đánh giá mô hình. IPS hoạt động bằng cách đánh lại trọng số của các mẫu dựa trên điểm số xu hướng, theo cách giảm trọng số của các mẫu thường quan sát được, trong khi tăng trọng số của các mẫu hiếm gặp. Điều này sẽ giúp kiểm soát được vấn đề thiên lệch của dữ liệu.

## 1.3 Tổng quan

Phần còn lại của khóa luận sẽ được trình bày như sau:

- Chương 2 trình bày kiến thức nền tảng về “Matrix factorization”, “Gradient descent”, “Naive bayes” và “Logistic regression”.
- Chương 3 trình bày về độ đo IPS và ứng dụng của nó trong việc đánh giá và huấn luyện mô hình; đây là phần chính của khóa luận. Trong phần này gồm có hai phần nhỏ:
  - Độ đo “Self normalized inverse propensity scoring” (SNIPS).
  - Ước lượng ma trận xu hướng: nhóm chúng em trình bày về cách ước lượng ma trận xu hướng thông qua 2 mô hình “Naive bayes” và “Logistic regression”.
- Chương 4 trình bày về các thí nghiệm và các kết quả đạt được.
- Cuối cùng, tổng kết và các hướng phát triển sẽ được trình bày ở chương 5.

## Chương 2

# Kiến thức nền tảng

*Trong chương này, đầu tiên nhóm chúng em trình bày về thuật toán “Matrix factorization” - thuật toán đề xuất sản phẩm bằng cách phân rã ma trận tương tác. Sau đó nhóm chúng em sẽ trình bày về thuật toán “Gradient descent” - thuật toán mà nhóm chúng em sẽ sử dụng để cực tiểu hóa hàm chi phí của “Matrix factorization”. Ngoài ra, nhóm chúng em còn trình bày về “Naive bayes” và “Logistic regression” - hai mô hình phân lớp mà nhóm chúng em sẽ sử dụng để tìm ma trận xu hướng trong IPS. Chương này, đặc biệt là về phần “Matrix factorization” cung cấp những kiến thức nền tảng để có thể hiểu rõ về những cải tiến mà nhóm em tìm hiểu ở chương kế tiếp.*

### 2.1 “Matrix factorization”

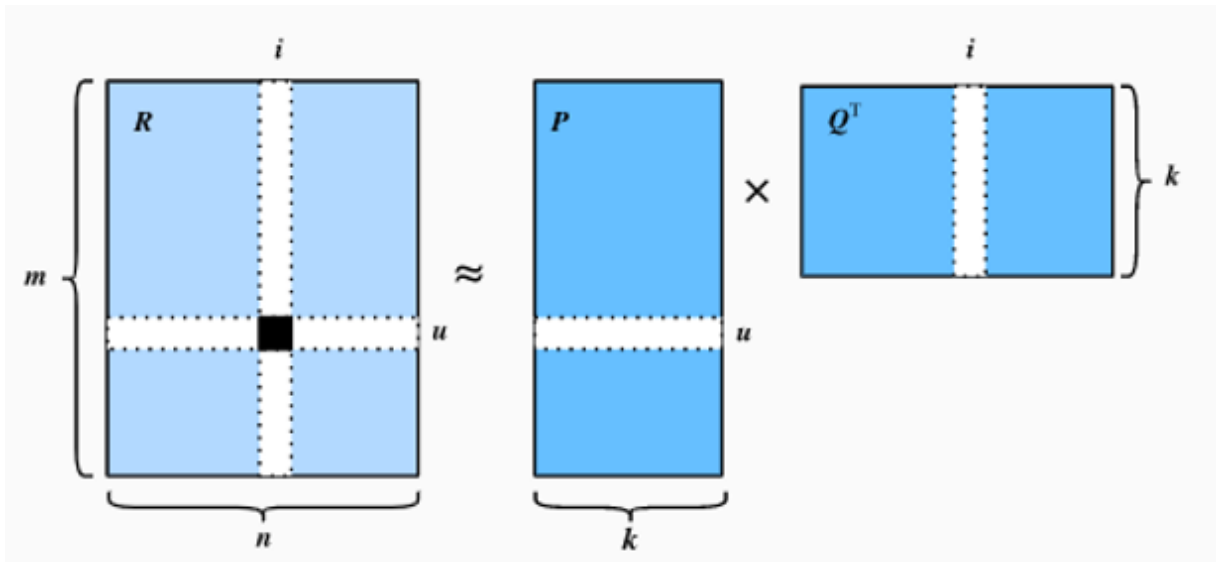
“Matrix factorization” là một phương pháp thuộc nhóm lọc cộng tác (collaborative filtering), một nhóm các phương pháp tập trung vào mối quan hệ giữa các người dùng, dựa trên đánh giá của các người dùng trước đó trong hệ thống. Các phương pháp lọc cộng tác này sẽ dựa trên ý tưởng những người dùng có cùng sở thích đối với một số sản phẩm nhất định, thì cũng có cùng sở thích đối với sản phẩm khác; do đó nó sẽ đề xuất sản phẩm cho người dùng dựa trên các sản phẩm mà người dùng giống với họ đã thích.



### 2.1.1 Hàm dự đoán của “Matrix factorization”

Phương pháp “Matrix factorization” sẽ phân tích ma trận tương tác của người dùng và sản phẩm  $R$  thành tích của hai ma trận  $P$  và  $Q$ , sao cho từ hai ma trận  $P$  và  $Q$  này ta có thể xây dựng lại được ma trận  $R$  càng chính xác càng tốt (hình 2.1 minh họa cách ước lượng ma trận tương tác). Một cách cụ thể, ma trận tương tác dự đoán được của ta có thể ước lượng như sau:

$$R \approx \hat{R} = P \times Q^T \quad (2.1)$$



Hình 2.1: Matrix Factorization. Ma trận tương tác  $R$  sẽ được phân rã thành ma trận đại diện cho người dùng  $P$  và đại diện cho sản phẩm  $Q$

Trong đó:

- Ma trận tương tác  $R$  là ma trận thưa có kích thước là  $m \times n$  tương ứng với  $m$  người dùng đánh giá cho  $n$  sản phẩm. Ma trận  $\hat{R}$  là ma trận dự đoán có cùng kích thước với  $R$ .
- Ma trận đại diện cho người dùng  $P$  là ma trận có kích thước  $m \times k$ , người dùng thứ  $u$  sẽ tương ứng với hàng thứ  $u$  trong ma trận và sẽ được kí hiệu là  $p_u$ .

- Tương tự, Ma trận đại diện cho người dùng  $Q$  là ma trận có kích thước  $k \times n$ , sản phẩm thứ  $i$  sẽ tương ứng với hàng thứ  $i$  trong ma trận và sẽ được kí hiệu là  $q_i$ .
- $k$  là hyperparameter được điều chỉnh trong quá trình huấn luyện mô hình, đại diện cho số lượng các đặc trưng tiềm ẩn. Các đặc trưng tiềm ẩn mô tả sự liên quan giữa các người dùng và các sản phẩm. Ví dụ như trong hệ thống đề xuất phim, các đặc trưng tiềm ẩn có thể là thể loại, ngôn ngữ, diễn viên hay bất kì các đặc trưng nào khác; hoặc có thể là bất cứ sự liên quan khác giữa người dùng và sản phẩm mà ta không cần đặt tên cụ thể.

Với mỗi sản phẩm  $i$  trong ma trận  $Q$ , các hệ số trong véc-tơ  $q_i$  sẽ đo lường mức độ sản phẩm  $i$  mang các đặc trưng ẩn, hệ số càng cao tương ứng với sản phẩm  $i$  mang đặc trưng đó càng lớn. Tương tự, với mỗi người dùng  $u$  trong ma trận  $P$ , các hệ số trong véc-tơ  $p_u$  sẽ đo lường mức độ yêu thích của người dùng  $u$  cho các đặc trưng ẩn, hệ số càng cao tương ứng với người dùng  $u$  càng thích các sản phẩm mang đặc trưng đó. Vì vậy, ta cần đề xuất cho người dùng  $u$  các sản phẩm  $i$  mang đặc trưng mà người dùng  $u$  thích, tương ứng với giá trị của  $p_u$  và  $q_i$  đều cao dẫn đến giá trị của  $p_u \times q_i^T$  càng cao.

Trong thực tế, một số người dùng sẽ có thiên hướng đánh giá cao hơn các người dùng khác, hay một số sản phẩm sẽ bị đánh giá thấp hơn trung bình. Do đó đánh giá của người dùng  $u$  cho sản phẩm  $i$  sẽ được tính toán bằng tích của hai véc-tơ  $p_u$  và  $q_i$  cộng thêm các offset cho riêng từng người dùng  $b_u$  từng sản phẩm  $b_i$  và giá trị trung bình cho toàn bộ đánh giá  $\mu$  theo công thức sau:

$$\hat{R}_{u,i} = p_u \times q_i^T + b_u + b_i + \mu \quad (2.2)$$

### 2.1.2 Tìm các tham số của hàm dự đoán của “Matrix Factorization”

Mục tiêu chính của việc huấn luyện mô hình “Matrix Factorization” là tìm giá trị của hai ma trận  $P$  và  $Q$ . Vì vậy hai ma trận này sẽ được ước lượng bằng cách cực tiểu hóa trung bình bình phương sai số giữa đánh giá dự đoán và đánh giá thực trên các đánh giá quan sát được. Hàm mục tiêu được định nghĩa cụ thể như sau:

$$C(W) = \underset{P, Q, b}{\operatorname{argmin}} \sum_{(u, i) \in \kappa} (R_{u, i} - \hat{R}_{u, i})^2 + \lambda(\|P\|_F^2 + \|Q\|_F^2 + b_u^2 + b_i^2) \quad (2.3)$$

Ở đây:

- $\kappa$  là tập dữ liệu chứa các đánh giá quan sát được.
- $\lambda$  là tham số regularization ( $0 \leq \lambda \leq 1$ ) và  $\lambda(\|p_u\|^2 + \|q_i\|^2 + b_u^2 + b_i^2)$  là regularization để tránh hiện tượng overfitting của mô hình.
- $\|\cdot\|_F$  là ký hiệu của chuẩn Frobenius, được tính toán là căn bậc hai của tổng bình phương tất cả các phần tử của ma trận.

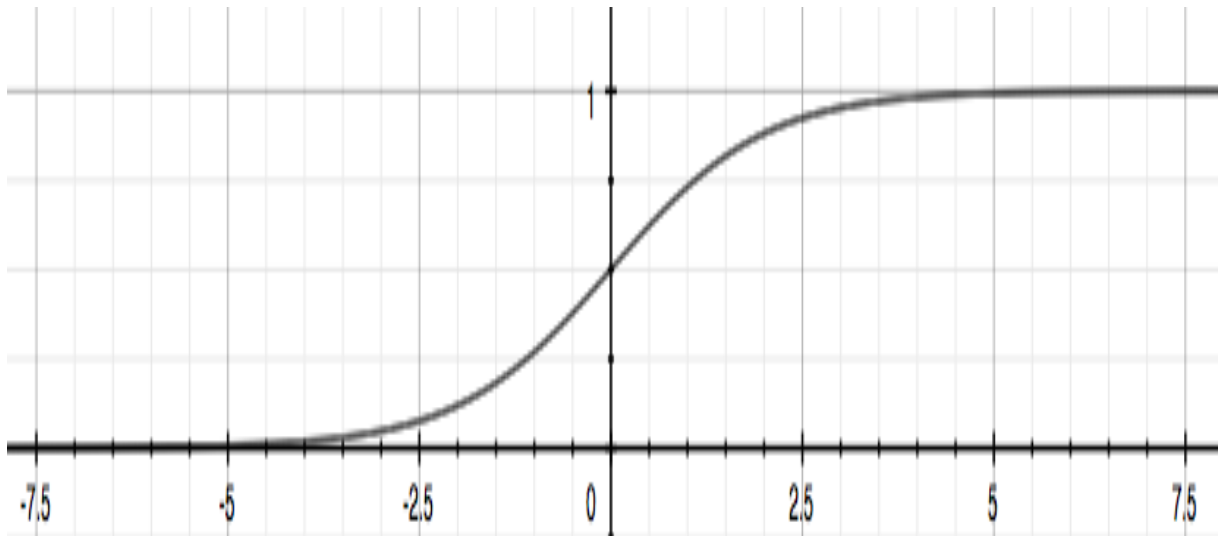
Để cực tiểu hóa hàm mục tiêu này, ta có thể sử dụng thuật toán “Gradient Descent” (sẽ được trình bày ở dưới).

## 2.2 “Logistic regression”

“Logistic regression” là một mô hình học có giám sát và được sử dụng trong bài toán phân lớp nhị phân. Mô hình này hoạt động bằng cách sử dụng hàm “sigmoid” để phân lớp các véc-tơ đầu vào. Trong khóa luận của nhóm chúng em, “Logistic regression” được sử dụng để ước lượng ma trận xu hướng (tiền đề cho việc tính toán độ đo IPS) thông qua các thuộc tính đặc trưng của người dùng và sản phẩm.

### 2.2.1 Hàm “sigmoid”

Hàm “sigmoid” là một hàm số liên tục có đạo hàm không âm tại mọi điểm. Hàm “sigmoid” sẽ ánh xạ tất cả số thực vào khoảng  $(0,1)$ , điều này làm cho nó trở thành một hàm phù hợp cho bài toán phân lớp. Hình 2.2 minh họa đồ thị hàm số “sigmoid”. Thông qua đồ thị ta có thể thấy khi đầu vào càng tiến đến  $+\infty$  giá trị khi đi qua hàm “sigmoid” càng tiến gần 1, ngược lại, khi đầu vào càng tiến đến  $-\infty$  giá trị khi đi qua hàm “sigmoid” càng tiến gần về 0.



Hình 2.2: Đồ thị hàm số “Sigmoid” (hình vẽ được lấy từ bài giảng của GS. Andrew Ng trong khóa học "Machine Learning" ở trang coursera.org)

Hàm “sigmoid” sẽ được tính toán thông qua công thức:

$$\sigma(x) = \frac{1}{1 + e^x} \quad (2.4)$$

### 2.2.2 Hàm dự đoán của “Logistic regression”

Với một véc-tơ đầu vào  $x \in \mathbb{R}^{D \times 1}$ , với  $D$  là số lượng đặc trưng của véc-tơ đầu vào, hàm dự đoán  $h(x)$  của “Logistic regression” sẽ trả về một giá trị nằm trong khoảng  $(0, 1)$ . Giá trị trả về này cho biết xác suất  $p(y = 1|x)$ , với  $y$  là đầu ra của véc-tơ đầu vào  $x$ . Khi đó, xác suất đầu ra  $y$  là 0 sẽ

được tính toán bằng  $[p(y = 0|x) = 1 - p(y = 1|x)]$ . Như vậy, ta có thể biết được véc-tơ đầu vào  $x$  thuộc lớp nào dựa trên một ngưỡng bằng 0.5, tức là  $h(x) \geq 0.5$  thì véc-tơ đầu vào  $x$  thuộc lớp 1 và ngược lại  $h(x) \leq 0.5$  thì véc-tơ đầu vào  $x$  sẽ thuộc lớp 0.

Cụ thể, hàm dự đoán  $h(x)$  của “Logistic regression” như sau:

$$\begin{aligned} h(x) &= p(y = 1|x) \\ &= \sigma(W^T x) \\ &= \frac{1}{1 + e^{-W^T x}} \end{aligned} \tag{2.5}$$

với  $W$  là các tham số của hàm dự đoán.

### 2.2.3 Tìm các tham số của hàm dự đoán của “Logistic regression”

**Xác suất**  $p(y|x)$

Mục đích của chúng ta là tìm các tham số của hàm dự đoán  $W$  sao cho  $h(x)$  càng gần với 1 càng tốt đối với các điểm dữ liệu thuộc lớp 1 và càng gần với 0 với các điểm dữ liệu thuộc lớp 0. Như đã đề cập ở trước:

$$p(y = 1|x) = \sigma(W^T x) \tag{2.6}$$

$$p(y = 0|x) = 1 - \sigma(W^T x) \tag{2.7}$$

Đặt giá trị dự đoán của mô hình là  $\alpha = \sigma(W^T x)$ , theo phân phối Bernoulli ta gộp 2 phương trình 2.6 và 2.7 lại thành:

$$p(y|x) = \alpha^y (1 - \alpha)^{1-y} \tag{2.8}$$

## Tìm tham số $W$

Cho tập huấn luyện  $(x^{(1)}, y^{(1)}), \dots, (x^{(N)}, y^{(N)})$ , với  $N$  là số lượng các véc-tơ đầu vào. Để tìm ra được tham số  $W$  của hàm dự đoán của “Logistic regression” ở công thức 2.5, ta sẽ dùng phương pháp “maximum likelihood”. Với giả định các mẫu dữ liệu trong tập huấn luyện được phát sinh một cách độc lập, ta có hàm “likelihood” sau:

$$\begin{aligned} L(W) &= p(Y|X) \\ &= \prod_{i=1}^N p(y^{(i)}|x^{(i)}) \\ &= \prod_{i=1}^N (\alpha^{(i)})^{y^i} (1 - \alpha^{(i)})^{1-y^i} \end{aligned} \tag{2.9}$$

Trong đó:

- $X = \{x^{(1)}, \dots, x^{(N)}\}$  và  $Y = \{y^{(1)}, \dots, y^{(N)}\}$ .

Ta tìm  $W$  sao cho hàm “likelihood”  $L(W)$  đạt cực đại. Cực đại  $L(W)$  tương đương với cực tiểu hàm “negative log-likelihood”  $-\log(W)$ .

Như vậy, ta sẽ tìm các tham số  $W$  của hàm dự đoán của “Logistic regression” sao cho hàm chi phí sau đạt cực tiểu:

$$\begin{aligned} C(W) &= -\log(L(W)) \\ &= -\sum_{i=1}^N (y^i \log(\alpha^{(i)}) + (1 - y^i) \log(1 - \alpha^{(i)})) \end{aligned} \tag{2.10}$$

Để cực tiểu hàm này, ta có thể sử dụng thuật toán “Gradient Descent” (sẽ được trình bày ở các phần sau).

## 2.3 “Naive bayes”

“Naive bayes” là một mô hình học có giám sát và thường được sử dụng trong bài toán phân lớp. Mô hình này hoạt động bằng cách sử dụng định lý “Bayes” để phân lớp các véc-tơ đầu vào, tuân theo một giả định là các biến đầu vào độc lập với nhau. Trong khóa luận của nhóm chúng em, “Naive bayes” được sử dụng để ước lượng ma trận xu hướng bằng cách sử dụng ma trận tương tác và một phần nhỏ dữ liệu kiểm tra tuân theo phân phối đều.

### 2.3.1 Định lý “Bayes”

Định lý “Bayes” là một định lý về xác suất có điều kiện. Nó được sử dụng để tính toán xác suất một biến cố  $A$  xảy ra khi biết biến cố  $B$  xảy ra, được tính toán thông qua công thức sau:

$$p(A|B) = \frac{p(B|A)p(A)}{p(B)} \quad (2.11)$$

Trong đó:

- $p(A|B)$  là xác suất biến cố  $A$  xảy ra với điều kiện biến cố  $B$  xảy ra. Tương tự,  $p(B|A)$  là xác suất biến cố  $B$  xảy ra với điều kiện biến cố  $A$  xảy ra.
- $p(A)$  và  $p(B)$  là xác suất xảy ra 2 biến cố  $A$  và  $B$  độc lập, không bị tác động bởi biến cố khác.

### 2.3.2 Hàm dự đoán của “Naive bayes”

Với một véc-tơ đầu vào  $x \in \mathbb{R}^{D \times 1}$ , với  $D$  là số lượng đặc trưng của véc-tơ đầu vào, hàm dự đoán  $h(x)$  của “Naive Bayes” sẽ trả về một véc-tơ gồm có  $K$  phần tử (ứng với  $K$  lớp), trong đó phần tử thứ  $k$  cho biết xác

suất  $p(y = k|x)$  với  $y \in \{1, 2, \dots, K\}$  là nhãn lớp của véc-tơ đầu vào  $x$ . Như vậy, véc-tơ đầu vào  $x$  sẽ thuộc lớp có xác suất lớn nhất.

$$\begin{aligned}
h(x) &= \begin{bmatrix} p(y = 1|x) \\ p(y = 2|x) \\ \vdots \\ p(y = k|x) \end{bmatrix} \\
&= \begin{bmatrix} \frac{p(x|y=1)p(y=1)}{p(x)} \\ \frac{p(x|y=2)p(y=2)}{p(x)} \\ \vdots \\ \frac{p(x|y=k)p(y=k)}{p(x)} \end{bmatrix} \\
&= \begin{bmatrix} p(x|y = 1)p(y = 1) \\ p(x|y = 2)p(y = 2) \\ \vdots \\ p(x|y = k)p(y = k) \end{bmatrix}
\end{aligned} \tag{2.12}$$

Trong đó:

- $p(y = k)$  là xác suất thuộc lớp  $k$ .
- $p(x|y = k)$  là xác suất véc-tơ đầu vào  $x$  thuộc lớp  $k$ .

### 2.3.3 Tìm các xác suất của hàm dự đoán của “Naive Bayes”

#### Xác suất $p(y)$

Gọi  $N$  là số lượng các mẫu huấn luyện,  $N_k$  ( $k \in 1, 2, \dots, K$ ) là số lượng các véc-tơ đầu vào thuộc lớp  $k$ . Xác suất  $p(y = k)$  có thể được tính toàn bằng số điểm dữ liệu trong tập huấn luyện thuộc lớp này chia cho tổng số điểm dữ liệu trong tập huấn luyện, được thể hiện cụ thể trong công thức



sau:

$$p(y = k) = \frac{N_k}{N} \quad (2.13)$$

### Xác suất $p(\mathbf{x}|\mathbf{y})$

Gọi  $x$  là một mẫu bất kỳ trong tập huấn luyện,  $\{x_1, x_2, \dots, x_d\}$  các thuộc tính của mẫu  $x$ , với  $d$  là số lượng các thuộc tính của mẫu  $x$ . Giả sử các mẫu trong tập huấn luyện được phát sinh một cách độc lập với nhau. Khi đó, xác suất đầu vào  $x$  thuộc lớp  $k$  là  $p(x|y = k)$  sẽ được tính toán theo công thức:

$$\begin{aligned} p(x|y = k) &= p(x_1, x_2, \dots, x_d|y = k) \\ &= \prod_{i=1}^d p(x_i|y = k) \quad \text{với } i \in (1, \dots, d) \end{aligned} \quad (2.14)$$

Với  $N_{x_i,k}$  là số lần đặc trưng  $x_i$  thuộc lớp  $k$ . Xác suất thuộc tính  $x_i$  thuộc lớp  $k$  sẽ được tính toán bằng số lượng thuộc tính của công thức sau:

$$p(x_i|y = k) = \frac{N_{x_i,k}}{N_k} \quad (2.15)$$

## 2.4 “Gradient descent”

“Gradient descent” là một thuật toán dùng để ước lượng các tham số trong hàm chi phí, nhằm mục đích tìm ra các tham số mà tại đó hàm chi phí đạt giá trị nhỏ nhất (hay nói cách khác là tìm điểm cực tiểu của hàm chi phí). Trong phạm vi khóa luận, thuật toán “Gradient descent” được sử dụng để tối ưu hàm chi phí của 2 mô hình “Matrix factorization” và “Logistic regression”.

### 2.4.1 Ý tưởng chính

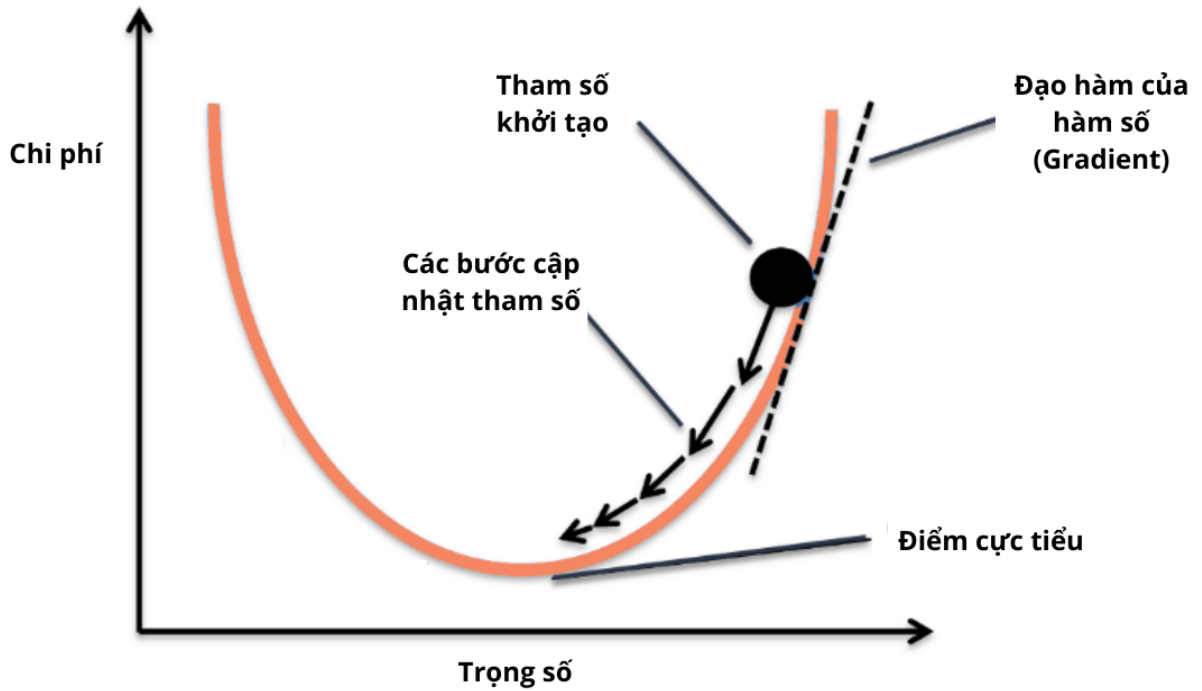
Thông thường khi tìm kiếm điểm cực tiểu của một hàm số  $f(x)$  nào đó ta sẽ tìm đạo hàm của hàm số đó  $f'(x)$  và điểm cực tiểu của hàm số sẽ là điểm có đạo hàm bằng 0. Đường tiếp tuyến của một điểm trong đồ thị của hàm số đó sẽ có hệ số góc bằng với đạo hàm của điểm đó, hệ số góc của đường tiếp tuyến tại điểm cực tiểu sẽ có giá trị bằng 0. Tuy nhiên, trong các bài toán học máy khi các hàm chi phí có thể rất phức tạp, hay các điểm dữ liệu có số chiều lớn thì việc tìm kiếm điểm cực tiểu bằng cách giải phương trình đạo hàm bằng 0 trở nên bất khả thi. Vì vậy thuật toán “Gradient descent” ra đời như là một phương pháp để giải quyết vấn đề này.

Thuật toán “Gradient descent” được minh họa trong hình 2.3 hoạt động theo ý tưởng như sau:

- Khởi tạo các tham số của hàm chi phí ngẫu nhiên, thông thường khởi tạo bằng 0 (đây có thể xem như là một điểm ngẫu nhiên nằm trên đồ thị hàm số chi phí).
- Sau đó ta thực hiện quá trình cập nhật tham số như sau: tính toán đạo hàm của hàm chi phí tại điểm đó, hệ số góc của tiếp tuyến chính là đạo hàm tại điểm đó, thông qua hệ số góc ta sẽ biết được phương hướng di chuyển. Cập nhật giá trị bộ tham số theo hướng giảm giá trị của hàm chi phí, tức là theo hướng có góc dốc nhất (đây có thể xem như là di chuyển đến điểm hướng xuống dốc).
- Lặp lại quá trình cập nhật tham số cho đến khi thỏa điều kiện dừng. Điều kiện dừng có thể là giới hạn số vòng lặp của việc cập nhật tham số; có thể khi giá trị của gradient trong hai lần cập nhật liên tiếp cách nhau rất nhỏ; hoặc cũng có thể là khi giá trị của hàm chi phí trong hai lần cập nhật liên tiếp cách nhau rất nhỏ.

Với  $W = W_0, W_1, \dots, W_k$  là véc-tơ chứa các tham số của hàm chi phí,  $k$  là số lượng các tham số;  $C(W)$  là hàm chi phí của mô hình dựa trên bộ

D



Hình 2.3: Minh họa quá trình tìm điểm cực tiểu của hàm chi phí thông qua thuật toán “Gradient descent”.

tham số  $W$ . Cụ thể, thuật toán “Gradient descent” sẽ được thực hiện bằng cách lặp lại quá trình cập nhật bộ tham số  $W$  cho đến khi thỏa điều kiện dừng như sau:

$$W_j = W_j - \alpha \frac{\partial C(W)}{\partial W_j} \quad (2.16)$$

Trong đó:

- $\alpha$  là siêu tham số đại diện cho learning rate của thuật toán, nó quyết định độ lớn của mỗi lần cập nhật. Khi *alpha* nhỏ sẽ dẫn đến mỗi lần cập nhật sẽ có độ lớn nhỏ hơn và khi *alpha* lớn thì mỗi lần cập nhật sẽ có độ lớn lớn hơn. Trong hình 2.3 *alpha* là độ lớn của mỗi mũi tên trong quá trình cập nhật tham số.
- $j \in \{0, 1, \dots, k\}$  là chỉ số của các tham số trong hàm chi phí.
- $\frac{\partial C(W)}{\partial W_j}$  là đạo hàm riêng của hàm chi phí, nó được sử dụng để xác

định hướng cập nhật của tham số. Trong hình 2.3 đạo hàm riêng của hàm chi phí được sử dụng để xác định hướng của mũi tên trong việc cập nhật tham số.

Siêu tham số  $\alpha$  là một tham số cực kì quan trọng trong thuật toán “Gradient descent”. Vì  $\alpha$  đại diện cho learning rate của thuật toán, nên khi  $\alpha$  quá nhỏ thuật toán “Gradient descent” sẽ tốn rất nhiều thời gian trong việc đạt đến điểm cực tiểu của hàm chi phí (hội tụ). Ngược lại, khi  $\alpha$  quá lớn mặc dù làm độ lớn của các tham số được cập nhật qua mỗi vòng lặp lớn hơn, tuy nhiên nó có thể dẫn đến việc các tham số cập nhật có thể bị vượt quá điểm cực tiểu, thậm chí có thể sẽ dẫn đến tình trạng thuật toán không thể đạt đến điểm cực tiểu của hàm chi phí (không thể hội tụ).

## Chương 3

# Phương pháp tìm hiểu

*Chương này nhóm chúng em trình bày về những đóng góp của bài báo mà nhóm chúng em tìm hiểu được. Ở đây, nhóm chúng em tập trung vào việc xử lý vấn đề thiên lệch dữ liệu, bằng cách sử dụng độ đo khắc phục thiên lệch IPS trong quá trình đánh giá và huấn luyện mô hình. Sau đó, nhóm chúng em trình bày về “Self Normalized Inverse Propensity Scoring” (SNIPS) và so sánh với IPS để thấy được sự kết nối giữa IPS và SNIPS cũng như là những điểm lợi và hại của IPS so với SNIPS. Ngoài ra, nhóm chúng em còn trình bày về phương pháp ước lượng ma trận để phục vụ cho việc tính toán độ đo IPS và SNIPS.*

### 3.1 Xem hệ thống gợi ý như một điều trị

Phần này giới thiệu về phương pháp giải quyết Như đã trình bày ở ví dụ về thiên lệch dữ liệu, ta có thể thấy rằng ta chỉ đang quan sát được một phần của dữ liệu mà không thể thấy được toàn bộ sự thật, điều này bị ảnh hưởng bởi rất nhiều yếu tố tiềm ẩn. Giống như việc khi ta muốn xem xét một loại thuốc hay một phương pháp điều trị nhất định có hiệu quả như thế nào đối với bệnh nhân, giả sử ta tiến hành thử nghiệm phương pháp điều trị đó trên một nhóm bệnh nhân, sau đó ta theo dõi tình trạng bệnh của các bệnh nhân đó, và ta quan sát được sức khỏe của bệnh nhân

có chuyển biến tích cực, liệu ta có thể kết luận được rằng phương pháp điều trị đó có thật sự hiệu quả không? Nếu xem xét kĩ lưỡng, có thể rằng phương pháp điều trị của ta có lẽ khá đắt tiền nên chỉ những người có điều kiện kinh tế ổn định mới có xu hướng dễ tiếp xúc với phương pháp điều trị đó. Mà những người như vậy thì sẽ nhiều điều kiện thuận lợi để chăm sóc sức khỏe bản thân hơn, dẫn đến việc tình trạng bệnh của họ có chuyển biến tích cực hơn. Do đó việc kiểm tra được độ hiệu quả một phương pháp điều trị không hề đơn giản, người ta thường sử dụng các mô hình nhân quả. Nếu ta xem mỗi người dùng như một bệnh nhân, mỗi bộ phim ta gợi ý giống như một phương pháp điều trị hoặc một loại thuốc, ta sẽ quan tâm đến việc người dùng có phù hợp với bộ phim mà ta gợi ý hay không, phim được gợi ý có khiến người dùng thích thú hay không. Từ đó ta có thể thấy bài toán gợi ý và bài toán được đưa ra khá tương đồng nhau, do có ta cũng sử dụng ý tưởng giải quyết của các phương pháp nhân quả đối với bài toán xem xét hiệu quả điều trị để gợi ý sản phẩm.

Trong ví dụ về xem xét hiệu quả của một phương pháp điều trị, ta thấy được rằng ta cần phải kiểm soát cả những biến làm ảnh hưởng đến xu hướng mà bệnh nhân có thể tiếp cận được với điều trị đó để mô hình trở nên chính xác hơn, ví dụ như những đặc trưng về nhân khẩu học, thu nhập, mức sống, vị trí sống,... Tuy nhiên sẽ có rất nhiều biến ẩn như vậy mà ta khó có thể kiểm soát được. Do đó phương pháp nghịch đảo điểm xu hướng ra đời (Inverse propensity scoring - IPS) với ý tưởng rằng ta không cần phải kiểm soát trực tiếp những biến ẩn, mà chỉ cần kiểm soát được xu hướng nhận được điều trị của những bệnh nhân.

Trong bài toán gợi ý, với giả định rằng người dùng có thể đánh giá hoặc không đánh giá một phim mà họ đã xem, một đánh giá của người dùng dành cho một sản phẩm có thể xuất hiện hoặc không xuất hiện trong tập dữ liệu mà ta qua sát được. Ta có thể biểu diễn điều này thông qua ma trận quan sát  $O$ , trong đó các giá trị  $O_{u,i} = 1$  tương ứng với đánh giá cho bộ phim  $i$  từ người dùng  $u$  được cung cấp tới hệ thống. Ta đặt  $P_{u,i}$  là xác suất mà đánh giá  $Y_{u,i}$  có thể quan sát được, hay  $P_{u,i} = P(O_{u,i} = 1)$ .  $P_{u,i}$

được gọi là điểm xu hướng của đánh giá  $Y_{u,i}$ . Từ các đặc trưng mà ta đã quan sát được về các người dùng, các bộ phim và ma trận quan sát  $O$ , ta có thể dự đoán được điểm xu hướng của ma trận đánh giá  $Y$ . Phương pháp này sẽ được giới thiệu ở phần tiếp theo của khóa luận này.

Matrix  $O$  (Movies vs. Genres):

	Horror				Romance				Drama	
1	1	1	1	1					1	
2		1	1			1			1	
3	1		1	1					1	
4		1	1				1			
5	1			1						1
6		1		1					1	
7					1	1	1	1	1	1
8					1	1		1		
9						1	1		1	
10					1	1		1		

$P$	Horror	Romance	Drama
	$p$	$p/10$	$p/2$
	$p/10$	$p$	$p/2$

Hình ảnh trên minh họa về việc biểu diễn ma trận quan sát  $O$  và ma trận xu hướng  $P$ . Trong ma trận quan sát  $O$  các vị trí có giá trị là 1 đại diện cho đánh giá của người dùng với sản phẩm xuất hiện trong hệ thống, ma trận xu hướng  $P$  chứa xu hướng của các đánh giá tương ứng với khả năng ta quan sát được các đánh giá, những phim có số lượt đánh giá nhiều sẽ có điểm xu hướng cao.

### 3.2 “Inverse propensity scoring” (IPS)

Nhắc lại về phương pháp tính độ lỗi mà ta thường sử dụng, ta ký hiệu ma trận đánh giá mà ta quan sát được là  $Y$ , ma trận đánh giá mà ta cần phải dự đoán là  $\hat{Y}$ . Cụ thể,  $Y$  là ma trận đánh giá với các đánh giá bị thiếu,  $\hat{Y}$  là ma trận đánh giá sau khi được điền đầy đủ các đánh giá bị thiếu. Đầu tiên, mục tiêu của ta là đi tìm một hàm tính độ lỗi của  $\hat{Y}$  so với  $Y$  mà phản ánh được độ lỗi thật sự chỉ bằng tập dữ liệu quan sát được



Y. Thông thường, hàm tính độ lỗi sẽ được biểu diễn như sau:

$$R(\hat{Y}) = \frac{1}{U \cdot I} \sum_{u=1}^U \sum_{i=1}^I \delta_{u,i}(Y, \hat{Y}) \quad (3.1)$$

Trong đó,  $\delta$  là một hàm tính độ lỗi bất kì Nhưng vì ta chỉ có thể quan sát được một phần của toàn bộ đánh giá, do đó ta chỉ tính trung bình độ lỗi của các đánh giá quan sát được, ta tạm gọi hàm lỗi này là hàm lỗi ngây thơ(Naive), hàm lỗi này có công thức như sau:

$$R_{Naive}(\hat{Y}) = \frac{1}{|\{(u, i) : O_{u,i} = 1\}|} \sum_{(u,i):O_{u,i}=1}^I \delta_{u,i}(Y, \hat{Y}) \quad (3.2)$$

Sự ngây thơ của hàm lỗi này đã dẫn đến việc đánh giá mô hình bị sai ở ví dụ về thiên lệch lựa chọn trong phần giới thiệu. Do mẫu dữ liệu mà ta quan sát được không được phát sinh ngẫu nhiên theo phân phối đều từ dữ liệu thực tế mà bị tác động bởi thiên lệch lựa chọn. Đó là lý do tại sao hàm lỗi ngây thơ lại có giá trị khác biệt so với độ lỗi thực tế, người ta gọi đây là một hàm lỗi bị lệch (bias), hay nói cách khác, kỳ vọng của hàm lỗi này khác với độ lỗi thực tế.

$$E_O[R_{Naive}(\hat{Y})] \neq R(\hat{Y})$$

Hiểu được vấn đề của hàm lỗi ngây thơ, tác giả đưa ra một hàm lỗi thay thế giúp giải quyết được vấn đề dữ liệu bị lệch. Phương pháp dựa trên một phương pháp thường được sử dụng trong các mô hình nhân quả, gọi là phương pháp nghịch đảo điểm xu hướng. Trong phạm vi của bài báo mà nhóm em tìm hiểu, tác giả tiến hành hai loại nghiên cứu là nghiên cứu quan sát và nghiên cứu thực nghiệm:

- Nghiên cứu thực nghiệm: trong nghiên cứu này, ta có thể điều khiển hệ thống gợi ý của ta bằng cách quyết định những sản phẩm nào sẽ được hiển thị đến người dùng, từ đó ta có thể biết được điểm xu

hướng của nó.

- Nghiên cứu quan sát: trong nghiên cứu này, ta sẽ thu thập dữ liệu có sẵn từ một hệ thống đánh giá phim có sẵn, trong hệ thống này người dùng có quyền tự chọn những bộ phim họ xem và đánh giá. Do đó, ta không biết được điểm xu hướng mà cần phải tiến hành ước lượng nó. Phương pháp ước lượng này sẽ được trình bày cụ thể trong phần 3.3 thông qua các mô hình như Naive Bayes và Logistic Regression.

Áp dụng nghịch đảo điểm xu hướng đã được nghiên cứu bởi Little và Rubin 2000; Thompson, 2012; Imbens và Rubin, 2015 để sử dụng cho hàm lỗi của hệ thống gợi ý, ta định nghĩa công thức tính độ lỗi IPS như sau:

$$R_{IPS}(\hat{Y}|P) = \frac{1}{U \cdot I} \sum_{(u,i):O_{u,i}=1} \frac{\delta_{u,i}(Y, \hat{Y})}{P_{u,i}} \quad (3.3)$$

Về cơ bản, điểm xu hướng này luôn luôn lớn hơn 0 ở mọi cặp người dùng - sản phẩm để chắc chắn mỗi phần tử trong ma trận đánh giá  $Y$  đều có thể được quan sát và tổng nghịch đảo các điểm xu hướng của các đánh giá mà ta quan sát được sẽ bằng với số lượng đánh giá của toàn bộ người dùng dành cho toàn bộ sản phẩm hay:

$$E_O \left[ \sum_{(u,i):O_{u,i}=1} \frac{1}{P_{u,i}} \right] = U \cdot I \quad (3.4)$$

**Bổ đề 3.2.1** (*Sự không thiên lệch của IPS*) Với mọi người dùng  $u$  và sản phẩm  $i$ , nếu điểm xu hướng  $P_{u,i} \in (0, 1)$  và  $P_{u,i} > 0$ , thì  $R_{IPS}(\hat{Y}|P)$  là một độ đo không thiên lệch của  $R(\hat{Y})$ , có nghĩa là kì vọng của  $R_{IPS}(\hat{Y}|P)$  bằng với  $R(\hat{Y})$

*Chúng minh.*

$$\begin{aligned}
E_O \left[ R_{IPS}(\hat{Y}|P) \right] &= \frac{1}{U \cdot I} \cdot \sum_{u=1}^U \sum_{i=1}^I \mathbb{E}_O \left[ \frac{\delta_{u,i}(Y, \hat{Y})}{P_{u,i}} O_{u,i} \right] \\
&= \frac{1}{U \cdot I} \cdot \sum_{u=1}^U \sum_{i=1}^I \delta_{u,i} \\
&= R(\hat{Y})
\end{aligned} \tag{3.5}$$

### 3.3 “Self normalized inverse propensity scoring” (SNIPS)

$$\hat{R}_{SNIPS}(\hat{Y}|P) = \frac{\frac{1}{U \cdot I} \sum_{(u,i): O_{u,i}=1} \frac{\delta_{u,i}(Y, \hat{Y})}{P_{u,i}}}{\sum_{(u,i): O_{u,i}=1} \frac{1}{P_{u,i}}} U \cdot I = \frac{\sum_{(u,i): O_{u,i}=1} \frac{\delta_{u,i}(Y, \hat{Y})}{P_{u,i}}}{\sum_{(u,i): O_{u,i}=1} \frac{1}{P_{u,i}}} \tag{3.6}$$

### 3.4 Ước lượng ma trận xu hướng

Trước tiên, để hiểu được các phương pháp ước lượng xu hướng của một đánh giá hay nói khác là khả năng mà một đánh giá được quan sát, ta cần hiểu được các loại mất mát dữ liệu. Đầu tiên là MAR (Missing At Random), có nghĩa là sự mất mát dữ liệu này là ngẫu nhiên. Kiểu mất mát này là kiểu ta thường giả định trong học máy. Ở kiểu mất mát này, ta có thể ước lượng được giá trị bị thiếu thông qua các giá trị quan sát được. Ví dụ như trong nghiên cứu về thông tin nhân khẩu học, nếu ta giả định rằng giá trị thu nhập bị thiếu là ngẫu nhiên thì ta có thể ước lượng thu nhập bị thiếu dựa vào các thông tin ta quan sát được như độ tuổi, nghề nghiệp, nơi sống,.. Tuy nhiên, một kiểu mất mát dữ liệu khác là MNAR (Missing Not At Random), ở kiểu mất mát này ta sẽ khó ước lượng được thu nhập bị thiếu vì các giá trị bị thiếu thường có một nguyên nhân nào đó, và nó mang một ý nghĩa nhất định. Trong trường hợp trên, có thể

những người dùng có thu nhập cao có xu hướng hạn chế công khai thu nhập của bản thân, do đó những thu nhập bị thiếu có thể cao hơn phần thu nhập ta quan sát được rất nhiều do đó không thể ước lượng bằng các mô hình học máy thông thường. Còn một kiểu mất mát khác là MCAR (Missing Completely At Random), có nghĩa là sự mất mát dữ liệu là hoàn toàn ngẫu nhiên, các mẫu mà ta quan sát được có thể xem như những mẫu đại diện, do đó ta có thể xóa những mẫu có dữ liệu bị thiếu. Ta có thể tìm hiểu kĩ hơn về các vấn đề mất mát dữ liệu trong nghiên cứu của Little và Rubin, 2002. Xét nghiên cứu quan sát trên tập dữ liệu ML100K được cung cấp bởi Grouplens, ta dễ thấy các đánh giá bị thiếu không phải do ngẫu nhiên (MNAR) mà do thiên lệch lựa chọn của người dùng và của hệ thống gợi ý đã sử dụng. Do đó ta không biết được xu hướng của các đánh giá mà cần ước lượng xu hướng  $P_{u,i}$  của mỗi đánh giá của người dùng  $u$  dành cho sản phẩm  $i$  sẽ được quan sát. Nói chung, xác suất một đánh giá ta có thể quan sát được có thể phụ thuộc vào các đặc trưng có thể quan sát được  $X$  (ví dụ như điểm số đánh giá dự đoán được hiển thị cho người dùng), các đặc trưng không thể quan sát được  $X^{hid}$  (ví dụ như sản phẩm đó có được giới thiệu bởi bạn bè của người dùng hay không), và đánh giá  $Y$ :

$$P_{u,i} = P(O_{u,i} = 1 | X, X^{hid}, Y) \quad (3.7)$$

Do đó khi các đặc trưng có thể quan sát được đã được sử dụng để tính toán, ta có cơ sở để giả định rằng  $O_{u,i}$  độc lập với ma trận dự đoán mới  $\hat{Y}$  nên nó độc lập với  $\delta_{u,i}(Y, \hat{Y})$ . Như đã đề cập ở trên, ta sử dụng hai phương pháp đơn giản để ước lượng ma trận xu hướng.

### 3.4.1 Ước lượng ma trận xu hướng thông qua Naive bayes

Để thực hiện được phương pháp Naive Bayes cho ước lượng ma trận xu hướng, ta cần phải giả định rằng sự phụ thuộc giữa các biến  $X$ ,  $X_{hid}$  và

các đánh giá khác là không đáng kể. Do đó công thức 3.7 được đơn giản thành  $P(O_{u,i}|Y_{u,i})$  tương tự như Marlin và Zemel (2009). Ta có thể xem  $Y_{u,i}$  như là những mẫu đánh giá mà ta quan sát được, khi đó ta chỉ cần ước lượng các điểm xu hướng cho những đánh giá quan sát được để tính toán IPS và SNIPS. Ta sử dụng Naive Bayes để ước lượng các xu hướng này như sau:

$$P(O_{u,i} = 1|Y_{u,i} = r) = \frac{P(Y = r|O = 1)P(O = 1)}{P(Y = r)} \quad (3.8)$$

Trong đó việc ước lượng hợp lý cực đại cho  $P(Y = r|O = 1)$  và  $P(O = 1)$  có thể được tính toán thông qua đếm số đánh giá quan sát được trong dữ liệu MNAR. Tuy nhiên, khi muốn ước lượng  $P(Y = r) = P(Y = r|O = 1) + P(Y = r|O = 0)$ , ta cần phải có một mẫu nhỏ MCAR. Phương pháp cụ thể để tìm tập nhỏ MNAR sẽ được trình bày ở phần thực nghiệm.

### 3.4.2 Ước lượng ma trận xu hướng thông qua Logistic regression

Một hướng tiếp cận khác để giải quyết việc ước lượng ma trận xu hướng là sử dụng hồi quy Logistic. Phương pháp này có ưu điểm là không yêu cầu một tập mẫu nhỏ MCAR. Cũng dựa trên công thức 3.7, nhưng mục tiêu của ta là tìm một bộ tham số  $\phi$  sao cho ma trận quan sát  $O$  có thể độc lập với ma trận ma trận đặc trưng không quan sát được  $X^{hid}$  và  $Y$ . Nói cách khác,  $P(O_{u,i} = 1|X, X^{hid}, Y) = P(O_{u,i}|X, \phi)$ . Ở phương pháp này, ta giả định rằng tồn tại một bộ tham số  $\phi = (\omega, \beta, \gamma)$  sao cho

$$P_{u,i} = \sigma(\omega^T X_{u,i} + \beta_i + \gamma_u) \quad (3.9)$$

Trong đó,  $X_{u,i}$  là vector được vector hóa từ những thông tin quan sát được về các cặp người dùng, sản phẩm (ví dụ như thông tin nhân khẩu học của người dùng, bộ phim có được quảng cáo hay không),  $\sigma(\cdot)$  là hàm sigmoid,

$\beta_i, \gamma_u$  là phần per-item và per-user

### 3.5 Phân rã ma trận kết hợp với IPS

Ở phần trước, ta đã tìm hiểu về phương pháp IPS và cải tiến của nó giúp giảm phương sai cho mô hình gọi là SNIPS, ngoài ra ta còn tìm hiểu về cách ước lượng xu hướng của các đánh giá hay còn gọi là xác suất để các đánh giá xuất hiện trong tập dữ liệu mà ta quan sát được. Trong phần này, dựa vào những kiến thức đã trình bày trước đó, nhóm em sẽ sử dụng hàm lỗi mới để phân rã ma trận dựa trên công thức 3.3.

Phát biểu bài toán: Với ma trận quan sát  $O$ , ma trận đánh giá  $Y$ , ma trận xu hướng  $P$ , không gian giả thuyết  $\mathcal{H}$  của các dự đoán  $\hat{Y}$  và hàm lỗi  $\delta_{u,i}(Y, \hat{Y})$ . Mục tiêu của ta là tìm  $\hat{Y}$  sao cho:

$$\hat{Y} = \underset{\hat{Y} \in \mathcal{H}}{\operatorname{argmin}} \left\{ \hat{R}_{IPS}(\hat{Y}|P) \right\} \quad (3.10)$$

Tiếp theo, để giải quyết bài toán dự đoán đánh giá  $\hat{Y}$ , ta sử dụng phương pháp phân rã ma trận (Matrix Factorization) như đã trình bày ở chương trước. Giả sử ta xem mô hình phân rã ma trận với nhiệm vụ dự đoán mỗi đánh giá  $\hat{Y}_{u,i} = v_u^T \omega_i + a_u + b_i + c$  với  $a_u$  là offset tương ứng của từng người dùng,  $b_i$  là offset của sản phẩm,  $c$  là offset toàn cục của không gian giả thuyết  $\mathcal{H}$ . Từ đó ta có thể xem mục tiêu huấn luyện của ta là:

$$\underset{V, W, A}{\operatorname{argmin}} \left[ \sum_{(u,i): O_{u,i}=1} \frac{\delta_{u,i}(Y, V^T W + A)}{P_{u,i}} + \lambda(\|V\|_F^2 + \|W\|_F^2) \right] \quad (3.11)$$

Với  $A$  tương ứng với offset và  $\hat{Y} = V^T W + A$

Ta có thể thấy rằng, các phương pháp phân rã ma trận truyền thống là một trường hợp đặc biệt của công thức 3.11, với tất cả những xu hướng

$P_{u,i}$  đều bằng nhau. Hay nói cách khác, khả năng xuất hiện của các đánh giá là như nhau, điều này xuất phát từ một giả định không chính xác của người dùng là dữ liệu đánh giá mà ta thu thập được là MCAR. Đây chính là điểm đặc biệt của mô hình mà nhóm em tìm hiểu. Mô hình này có vẻ không có quá nhiều khác biệt so với các mô hình thông thường được xây dựng trước đó, chỉ khác nhau một phần nhỏ ở hàm mục tiêu. Tuy nhiên, thách thức của việc tìm được ma trận xu hướng  $P$  là khá lớn, và khó để tìm chính xác được một ma trận xu hướng  $P$  để ta có thể thấy được toàn bộ dữ liệu thật sự dựa vào dữ liệu quan sát được.

## Chương 4

# Các kết quả thí nghiệm

*Trong chương này, nhóm chúng em trình bày các kết quả thí nghiệm để đánh giá các đề xuất tìm hiểu được từ bài báo đã được nói ở chương trước. Bộ dữ liệu được dùng để tiến hành thí nghiệm là bộ COAT (bao gồm đánh giá của người dùng cho áo khoác), bộ Yahoo (bao gồm đánh giá của người dùng cho các bài hát), bộ Movielens 100K (bao gồm đánh giá của người dùng cho các bộ phim). Các kết quả thí nghiệm cho thấy khi dùng IPS đánh giá mô hình hoàn toàn khớp với hiệu suất thật và tốt hơn nhiều so với các độ đo đánh giá truyền thống. Các kết quả thí nghiệm cũng cho thấy mô hình được huấn luyện dựa trên độ đo IPS cũng cho kết quả tổng quát hóa tốt hơn trên các mức độ selection bias khác nhau.*

### 4.1 Các thiết lập thí nghiệm

Nhóm chúng em tiến hành thí nghiệm đánh giá hiệu suất trên 2 bộ dữ liệu thế giới thực; 2 bộ dữ liệu thế giới thực này đều có tập kiểm tra (test) riêng biệt, trong đó đánh giá của các người dùng đều từ một tập các sản phẩm được lấy ngẫu nhiên theo phân phối đều.

- Tập dữ liệu Yahoo! R3: tập dữ liệu này chứa đánh giá của các người dùng cho các bài hát. Tập dữ liệu huấn luyện bị thiên lệch cung cấp hơn 300 nghìn đánh giá cho các bài hát, các bài hát này được tự lựa



chọn bởi 15400 người dùng. Tập dữ liệu kiểm tra chứa đánh giá của 5400 người dùng cho 10 bài hát được chọn ngẫu nhiên theo phân phối đều.

- Tập dữ liệu Coat Shopping: tập dữ liệu này chứa đánh giá của các người dùng cho các áo khoác, được thu thập bằng cách mô phỏng dữ liệu bị thiên lệch của những người dùng mua áo khoác trong cửa hàng trực tuyến. Những người dùng được yêu cầu phải đánh giá 24 chiếc áo khoác họ tự chọn và 16 chiếc áo khoác được chọn ngẫu nhiên theo phân phối đều dựa trên thang điểm từ 1 đến 5. Tập dữ liệu chứa đánh giá từ 290 người dùng cho 300 sản phẩm. Các điểm đánh giá do người dùng tự lựa chọn sẽ được sử dụng làm tập huấn luyện, đồng thời, các điểm đánh giá trên tập các sản phẩm ngẫu nhiên sẽ được dùng để kiểm tra.

## 4.2 Đánh giá hiệu suất trên dữ liệu thế giới thực

Mục tiêu: Nhằm đánh giá hiệu suất của mô hình “Matrix factorization” tiêu chuẩn (MF-Standard) và “Matrix factorization” (MF-IPS) sử dụng độ đo IPS trên 2 tập dữ liệu thế giới thực là Yahoo và Coat.

Để sử dụng độ đo IPS trong việc huấn luyện mô hình “Matrix Factorization” trên 2 bộ dữ liệu ta tiến hành như sau:

- Tập dữ liệu Yahoo: ta ước lượng ma trận xu hướng bằng phương pháp “Naive Bayes”. Xác suất biên  $P(Y = r)$  sẽ được tính toán thông qua 5% của tập kiểm tra và 95% còn lại sẽ được sử dụng để kiểm tra mô hình.
- Tập dữ liệu Coat: ta ước lượng ma trận xu hướng bằng phương pháp “Logistic Regression” dựa trên hiệp biến của người dùng (giới tính, nhóm tuổi, vị trí và nhận thức về thời trang) và hiệp biến của sản

phẩm (giới tính, loại áo khoác, màu sắc, và nó đã được khuyến mãi chưa). Mô hình “Logistic Regression” sẽ được huấn luyện bằng cách sử dụng tất cả các cặp hiệp biến của người dùng và sản phẩm làm các đặc trưng đầu vào, với nhãn là điểm đánh giá của người dùng cho các sản phẩm tương ứng; mô hình sẽ được cross-validation để tối ưu trên tập dữ liệu quan sát được do người dùng tự lựa chọn.

Kết quả: Bảng 4.1 cho thấy hiệu suất của mô hình MF-IPS khi so sánh với MF-Standard, có thể thấy phương pháp MF-IPS có hiệu suất vượt trội hơn đáng kể khi so sánh với phương pháp thông thường.

	Yahoo		Coat	
	MAE	MSE	MAE	MSE
MF-IPS	0.810	0.989	0.860	1.093
MF-Standard	1.154	1.891	0.920	1.202

Bảng 4.1: Hiệu suất trên 2 tập dữ liệu Yahoo và Coat

### 4.3 Dữ liệu thiên lệch ảnh hưởng đến việc đánh giá như thế nào?

## Chương 5

# Tổng kết và hướng phát triển

# Tài liệu tham khảo

## Tiếng Anh

- [3] Marlin, Benjamin et al. “Collaborative Filtering and the Missing at Random Assumption”. In: *Proceedings of the Twenty-Third Conference on Uncertainty in Artificial Intelligence*. 2007, pp. 267–275.
- [4] Schnabel, Tobias et al. “Recommendations as Treatments: Debiasing Learning and Evaluation”. In: *ICML* 48 (2016), 1670—1679.