

中国科学院大学

试题专用纸

所属学期: 2017-2018 学年秋季第一学期

课程编号: 251M1001H

课程名称: 模式识别

任课教师: 刘成林、向世明、张熙尧

姓名_____ 学号_____ 成绩_____

1. (10 分) 对一个 c 类分类问题, 假设各类先验概率为 $P(\omega_i), i=1, \dots, c$, 条件概率密度为 $P(\mathbf{x} | \omega_i), i=1, \dots, c$ (这里 \mathbf{x} 表示特征向量), 将第 j 类模式判别为第 i 类的损失为 λ_{ij} 。

(1) (5 分) 请写出贝叶斯最小风险决策和最小错误率决策的决策规则;

(2) (5 分) 引入拒识 (表示为第 $c+1$ 类), 假设决策损失为

$$\lambda_{ij} = \begin{cases} 0, & i=j \\ \lambda_r, & i=c+1 \\ \lambda_s, & \text{otherwise} \end{cases}$$

请写出最小损失决策的决策规则 (包括分类规则和拒识规则)。

2. (10 分) 在二维特征空间中, 两个类别的概率密度为高斯分布 (正态分布), 参数分别为 $\mu_1 = (1, 0)^T$,

$$\mu_2 = (-1, 0)^T, \Sigma_1 = \Sigma_2 = \begin{bmatrix} 1 & 0.5 \\ 0.5 & 1 \end{bmatrix}, \text{先验概率 } P(\omega_1) = P(\omega_2) = 0.5,$$

(1) (6 分) 请给出分类误差最小的贝叶斯决策的决策面函数, 并写出贝叶斯错误率 (写成积分形式即可);

(2) (4 分) 当 $\lambda_{11} = \lambda_{22} = 0, \lambda_{12} = 2\lambda_{21}$, 请给出损失最小的贝叶斯决策的决策面函数。

3. (15 分) 特征空间中概率密度的非参数估计近似为 $p(\mathbf{x}) = \frac{k/n}{V}$, 其中 V 为 \mathbf{x} 周边邻域的体积, k 为邻域内样本数, n 为总样本数。基于此定义,

(1) (5 分) 请说明 Parzen 窗估计和 k -近邻 (k -NN) 估计的区别。

$$p(\mathbf{x}) = \frac{1}{nh_n} \sum_{i=1}^n \psi\left(\frac{\mathbf{x}-\mathbf{x}_i}{h_n}\right) = \frac{k}{nh_n} = \frac{k/n}{h_n}$$

(2) (5 分) 设一维特征空间中的窗函数 $\varphi(u) = \begin{cases} 1, & |u| < 1/2 \\ 0, & \text{otherwise} \end{cases}$, 现有 n 个样本 $x_i, i=1, \dots, n$, 采用宽度为 h_n

的窗函数, 请写出概率密度函数 $p(x)$ 的 Parzen 窗估计 $p_n(x)$;

(3) (5 分) 给定一维空间中的三个样本点 $\{-1, 0, 2\}$, 请写出概率密度函数 $p(x)$ 的最近邻 (1-NN) 估计并画出概率密度函数曲线图。

4. (共 11 分)

(1) (6 分) 对多类分类可采用 one-vs-all 技巧构建 c 个线性判别函数: $g_i(\mathbf{x}) = \mathbf{w}_i^T \mathbf{x} + b_i, i = 1, 2, \dots, c$, 并假定决策规则为: “对 $j \neq i$, 如果 $g_i(\mathbf{x}) > g_j(\mathbf{x})$, \mathbf{x} 则被分为 ω_i 类”。现有一个二维空间中的三类分类问题, 其判别函数分别为 $g_1(\mathbf{x}) = -x_1 + x_2$; $g_2(\mathbf{x}) = x_1 + x_2 - 5$; $g_3(\mathbf{x}) = -x_2 + 1$ 。请画出分类决策面。

(2) (5 分) 请简述感知器 (感知准则函数) 算法的基本思想, 并给出一种感知器学习算法。

5. (共 12 分)

(1) (4 分) 请从混合高斯密度函数估计的角度, 简述 K-Means 聚类算法的原理。

(2) (8 分) 现有六个二维空间中的样本: $\mathbf{x}_1 = (-6, 1)^T$ 、 $\mathbf{x}_2 = (-6, -1)^T$ 、 $\mathbf{x}_3 = (-4, 0)^T$ 、 $\mathbf{x}_4 = (4, 0)^T$ 、 $\mathbf{x}_5 = (5, 1)^T$ 、 $\mathbf{x}_6 = (6, -1)^T$ 。这里, 上标 T 表示向量转置。请按最小距离准则对上述六个样本进行分级聚类, 并画出聚类系统树图。

6. (共 15 分)

给定 d 维空间中的 n 个样本 $\{\mathbf{x}_1, \mathbf{x}_2, \dots, \mathbf{x}_n\} \subset \mathcal{R}^d$, 已知它们分别属于 c 个不同的类别。现在拟利用这些样本来训练一个三层前向神经网络 (即包含一个输入层, 一个隐含层和一个输出层)。假定采用如下交叉熵损失函数作为该网络的目标函数:

$$E_{ce}(\mathbf{w}) = -\sum_{k=1}^n \sum_{j=1}^c t_j^k \ln(z_j^k),$$

这里, t_j^k 表示样本 \mathbf{x}_k 在输出层第 j 个结点的期望输出值 (即该值已知, 由样本 \mathbf{x}_k 的已知类别标签来决定),

z_j^k 表示样本 \mathbf{x}_k 在输出层第 j 个结点的实际输出值 (即通过网络计算所得的输出值), \mathbf{w} 同时记录网络输入层至隐含层的各个权重 $\{w_{ih}\}$ 以及隐含层至输出层的各个权重 $\{w_{hj}\}$ 。请结合上述三层前向神经网络, 推导误差反向传播算法, 并写出具体的推导过程。

7. (12 分)

(1) (4 分) 简述 PCA (主成份分析) 的主要思想及其求解过程;

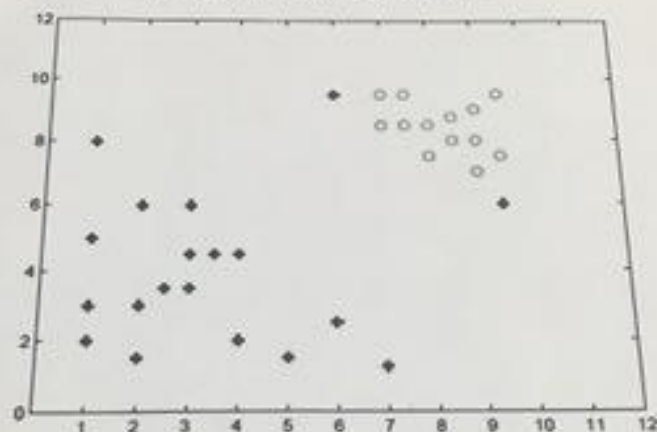
(2) (4 分) 比较 PCA、CCA、LDA、ICA 的区别和适用场景;

(3) (4 分) 解释 LDA (线性判别分析) 所基于的数据分布假设, 并阐述其不足之处。

8. (15 分) 解答下面关于支持向量机 (SVM) 的问题。

现有一批训练数据 (有噪声), 其样本分布如图所示。现在, 拟基于这些数据训练一个 SVM 分类器 (二分类), 以便于对测试数据进行分类。假设判别函数使用二阶多项式核函数。根据 SVM 原理, 软间隔惩罚参数 C 会影响决策边界的位置。在下列各小题中, 请定性画出分类决策边界, 并用一两句话说明产生此边界的理由。

(1) (3分) 当参数 C 取值特别大时 (比如 $C \rightarrow \infty$), (在答题纸上) 画出相应的分类决策边界, 并说明理由; (注: 按下图所示, 先在答题纸上画出样本分布的图)



(2) (3分) 当参数 C 取值特别小时 (比如 $C \approx 0$), (在答题纸上) 画出相应的分类决策边界, 并说明理由; (注: 如图所示, 先在答题纸上画出样本分布的图)

(3) (3分) 对于 (1) 和 (2) 中的两种情形, 你认为哪一种会在测试数据上表现出较好的性能, 并给出相应的解释。

(4) (6分) 写出 Soft-margin SVM 的原问题及其对偶问题, 并阐述核方法 (kernel method) 的基本思想是如何将线性模型转化为非线性模型的。