



Otto-Friedrich Universität Bamberg
Lehrstuhl für Statistik und Ökonometrie
Statistical Machine Learning

Support Vector Machines

Autoren:

Niklas Münz
Matrikel Nr.: 2150715

Franz Andersch
Matrikel Nr.: 2154877

Studiengang:

MSc. Survey Statistics
& Data Analysis

Sommersemester 2024

Inhaltsverzeichnis

1	Einleitung	1
2	Funktionsweise	1
2.1	Hard Margin Classifier	1
2.2	Soft Margin Classifier	3
2.3	Der Kernel Trick	4
3	Vor- und Nachteile der Methode	6
4	Daten	7
5	Hypothesen	8
6	Ergebnisse	9
6.1	Analyse	9
6.2	Auswertung	10
	Literatur	11

1 Einleitung

2 Funktionsweise

2.1 Hard Margin Classifier

Um das grundlegende Prinzip der SVMs darzustellen gehen wir zuerst von einer Datensituation aus, in der sich zwei Gruppen optimal durch eine lineare Entscheidungsgrenze trennen lassen. Das endgültige Ziel ist es eine sogenannte Hyperplane zu finden die diese Daten möglichst gut separiert und als Entscheidungsgrenze funktioniert. Die allgemeine Form einer solchen Hyperplane lautet

$$\beta_0 + \beta_1 X_1 + \beta_2 X_2 + \dots + \beta_n X_n = 0 \quad (1)$$

oder in Vektorschreibweise

$$\bar{\beta} \cdot \bar{x} + \beta_0 = 0 \quad (2)$$

Die geometrische Interpretation des Vektors β und des Skalars β_0 wird in Abbildung 1 im zwei-dimensionalen Fall dargestellt.

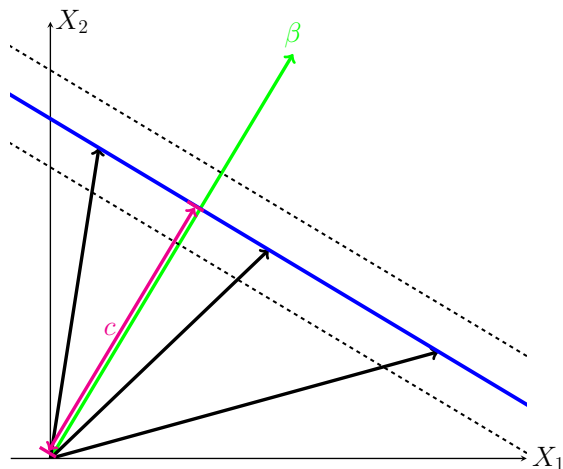


Abbildung 1: Konstruktion der Hyperebene

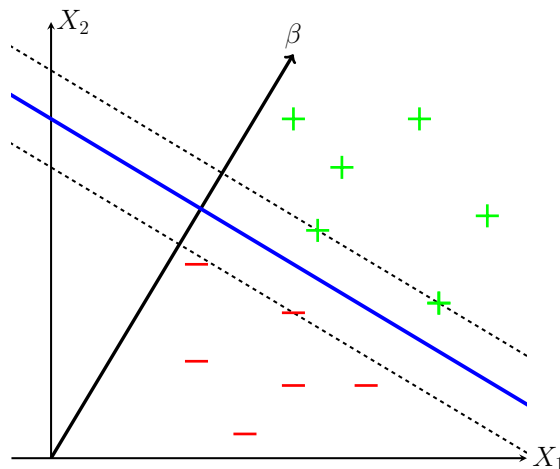


Abbildung 2: Konstruktion der Margins

Die blaue Linie soll die Hyperplane darstellen. Im zweidimensionalen handelt es sich hier um eine Linie. Der 2×1 Vektor β liegt immer senkrecht zur konstruierten Hyperplane. Würde man alle Vektoren, die auf der Hyperplane landen, auf den β -Vektor projizieren, dann hätten alle diese Projektionen die selbe Länge c . Also gilt für alle Punkte, die auf der Ebene liegen.

$$\frac{\bar{\beta}}{||\bar{\beta}||} \cdot \bar{x} = c \Leftrightarrow \bar{\beta} \cdot \bar{x} = c \cdot ||\bar{\beta}|| \quad (3)$$

ersetzt man in (3) $c \cdot ||\bar{\beta}||$ mit $-\beta_0$ und zieht dies dann auf die andere Seite, kommen man wieder bei der ursprünglichen Form aus Formel (2) raus.

Als nächstes stellt sich jetzt die Frage, welches $\bar{\beta}$ und β_0 die optimale Hyperplane darstellen. Betrachtet man die Abbildung 2, dann ist zu erkennen, dass die Datenpunkte durch die blaue Linie getrennt werden. Allerdings könnte man theoretisch unendlich viele andere Hyperplanes durch Rotation oder Verschiebung konstruieren, die trotzdem die Daten in ihren Ausprägungen trennen. Um eine eindeutige Lösung zu finden, wird als nächstes ein Bereich um die Hyperplane abgesteckt. In Abbildung 2 dargestellt durch die gestrichelten schwarzen Linien, welche man als Schranken bezeichnen könnte. In diesem Bereich sollen keine Datenpunkte liegen und die Schranken sollen immer parallel zur Hyperplane sein und den gleichen Abstand zu ihr haben.

Außerdem dürfen keine positiven Samples unterhalb der oberen Schranke liegen und keine negativen unterhalb. Das Gegenteil gilt dementsprechend für die untere Schranke. Als Definition für die beiden Schranken wird festgelegt

$$\bar{\beta} \cdot \bar{x} + \beta_0 = 1 \quad (4)$$

für die Schranke in richtung der grünen Datenpunkte und

$$\bar{\beta} \cdot \bar{x} + \beta_0 = -1 \quad (5)$$

für die Schranke in Richtung der roten Datenpunkte. Aus dieser Beschränkung für die Hyperplane können wir auch ableiten, dass für die positiven Samples \bar{x}^+ immer gilt $\bar{\beta} \cdot \bar{x}^+ + \beta_0 \geq 1$ und für negative Samples \bar{x}^- immer gilt $\bar{\beta} \cdot \bar{x}^- + \beta_0 \leq -1$. Durch einführen einer weiteren Variable y , welche die eigenschaft hat, dass die den Wert 1 bei einem positiven und den Wert -1 bei einem negativen Sample annimmt, können diese zwei Beschränkungen zu einer zusammengefasst werden

$$y_i(\bar{\beta} \cdot \bar{x}_i + \beta_0) \geq 1 \quad (6)$$

Da das Verfahren auch maximum Margin Classifier genannt wird, gilt es jetzt noch eine Definition für den Margin also den Abstand zwischen den zwei Schranken zu finden, der schließlich maximiert werden soll. Damit diese Schranken, maximal weit auseinander liegen, muss es zwangsläufig Datenpunkte geben, die genau auf den Schranken liegen. Diese Datenpunkte haben eine wichtige Rolle für die Konstruktion des Margins. Es sind ausschließlich diese Datenpunkte, die einen Einfluss auf die finalen werte von $\bar{\beta}$ und β_0 haben werden. Sie werden **Support-Vektoren** genannt und geben den SVMs ihren Namen.

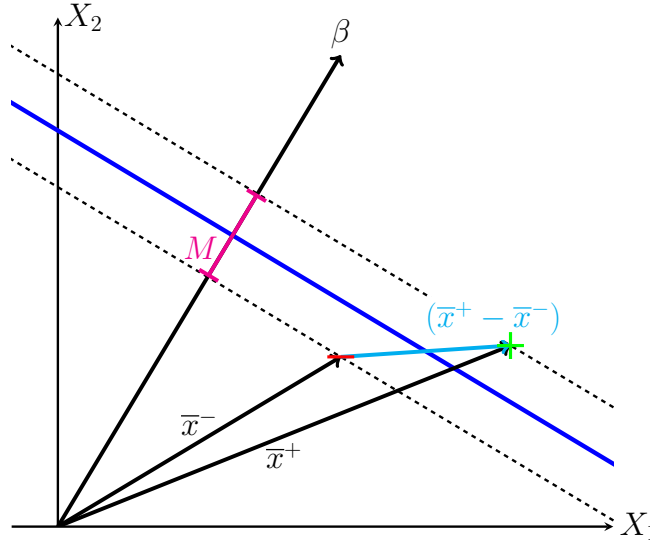


Abbildung 3: Abhängigkeit des Margins von den Support-Vektoren

In Abbildung 3 sind zwei solcher Support-Vektoren zu einem negativen und positiven Sample dargestellt. Der Margin kann dann dargestellt werden als eine Projektion dieser Differenz $(\bar{x}^+ - \bar{x}^-)$ auf den $\bar{\beta}$ -Vektor. Damit am Ende die Länge dieses Margins M rauskommt muss $\bar{\beta}$ noch durch seine Länge geteilt werden.

$$M = \frac{\bar{\beta}}{\|\bar{\beta}\|} \cdot (\bar{x}^+ - \bar{x}^-) = \frac{\bar{\beta} \cdot \bar{x}^- - \bar{\beta} \cdot \bar{x}^+}{\|\bar{\beta}\|} \quad (7)$$

Es ist bekannt, dass für positive Supportvektoren gilt $\bar{\beta} \cdot \bar{x}^+ + \beta_0 = 1 \Leftrightarrow \bar{\beta} \cdot \bar{x}^+ = 1 - \beta_0$ und für negative $\bar{\beta} \cdot \bar{x}^- + \beta_0 = -1 \Leftrightarrow \bar{\beta} \cdot \bar{x}^- = -1 - \beta_0$. Setzt man dies ein in (7), erhält man als Maximisierungsziel

$$M = \frac{1 - \beta_0 - (-1 - \beta_0)}{\|\bar{\beta}\|} = \frac{2}{\|\bar{\beta}\|} \quad (8)$$

Um diesen Maximierungsschritt angenehmer zu gestalten, wird an der Stelle versucht den Ausdruck $\frac{1}{2}||\bar{\beta}'||^2 = \frac{1}{2}\bar{\beta}' \cdot \bar{\beta}$ zu minimieren. Was im Endeffekt ebenfalls dazu führt, dass der Ausdruck in (8) maximiert wird.

Dieses Optimierungsproblem mit der Nebenbedingung aus Formel (6) lässt sich am besten über Lagrange-Multiplier lösen

$$\mathcal{L}(\bar{\beta}, \beta_0, \bar{\alpha}) = \frac{1}{2}\bar{\beta}'\bar{\beta} - \sum \alpha_i [y_i(\bar{\beta} \cdot \bar{x}_i + \beta_0) - 1] \quad (9)$$

Wird dieser Ausdruck partiell abgeleitet und gleich null gesetzt erhält man als Zwischenergebnis

$$\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \bar{\beta}} = \bar{\beta} - \sum \alpha_i y_i \bar{x}_i \stackrel{!}{=} 0 \Rightarrow \bar{\beta} = \sum \alpha_i y_i \bar{x}_i \quad (10)$$

somit zeigt sich, dass $\bar{\beta}$ als Linearkombination der Inputvektoren dargestellt werden kann. Weiterhin gilt für β_0

$$\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \beta_0} = \sum \alpha_i y_i \bar{x}_i \stackrel{!}{=} 0 \quad (11)$$

Setzt man dies in (9) ein erhält man einen neuen Ausdruck, denn es gilt zu minimieren

$$\mathcal{L}(\bar{\alpha}) = -\frac{1}{2} \sum \sum \alpha_i \alpha_j y_i y_j \bar{x}_i \cdot \bar{x}_j + \sum \alpha_i \quad (12)$$

Die Lösung für diesen Ausdruck erfolgt dann über sogenannte „standard non linear optimization algorithms for quadratic forms“ (Boser et al., 1992). Nachdem für $\bar{\alpha}$ gelöst wurde, kann dies in (10) eingesetzt werden um das optimale $\bar{\beta}$ zu erhalten. Es kann gezeigt werden, dass die gelösten α_i lediglich für die Supportvektorenwerte ungleich Null annehmen. Somit ist der Koeffizientenvektor $\bar{\beta}$ sogar eine Linearkombination von nur den Supportvektoren (Boser et al., 1992). Die letzte unbekannte β_0 kann gelöst werden, indem man mithilfe von einem positiven/negativen Support Vektor (4)/ (5) nach β_0 löst.

Mit den gelösten Werten zur optimalen Hyperplane kann jetzt auch eine Entscheidungsregel für ungelabelte Datenvektoren \bar{x}_u konstruiert werden. Bedenkt man also wenn man einen Vektor der nicht auf der Hyperplane liegt in (3) einsetzt erhält man also $\frac{\bar{\beta}}{||\bar{\beta}||} \cdot \bar{x}_u = c + k$. Wenn k positiv ist, liegt der neue Datenpunkt oberhalb der Hyperplane und somit als positives Sample gewertet. Wenn k negativ ist, dann liegt der Datenpunkt unterhalb der Hyperplane und wird als negativ gewertet. Mit der gleichen Umformung wie weiter oben schon beschrieben kommt man zu folgender Entscheidungsregel

$$f(\bar{x}_u) = \begin{cases} \text{positiv} & \text{wenn } \bar{\beta} \cdot \bar{x}_u + \beta_0 > 0 \\ \text{negativ} & \text{wenn } \bar{\beta} \cdot \bar{x}_u + \beta_0 < 0 \end{cases} \quad (13)$$

2.2 Soft Margin Classifier

Dass die Daten sich perfekt linear trennen lassen ist zwar ein Gut um die Vorgehensweise zu veranschaulichen, tritt aber in realen Situationen so gut wie nie auf. Falls sich positive und negative Samples im Raum überlappen, ist die Konstruktion einer Hyperplane wie beim Hard Margin Classifier unmöglich. Man müsste also entweder auf eine nicht lineare Hyperplane ausweichen oder man erweicht die Vorgaben für die Konstruktion der Hyperplane. Zweiteres ist genau das, was durch die Soft Margin Classifier erreicht wird. Die Vorgabe für die Konstruktion der Schranken ermöglicht es einzelnen Datenpunkten auf der falschen Seite der Schranke, ja sogar der Entscheidungsgrenzen zu liegen. Dafür wird für die Einschränkungen eine sogenannte Slackvariable ε eingeführt (James et al., 2021). Setzt man diese in (6) lautet die neue Nebenbedingung

$$y_i(\beta \cdot \bar{x}_i - \beta_0) > 1 - \varepsilon_i \quad (14)$$

Jetzt könnte man versuchen diese neue Nebenbedingung einfach in das zuvor angewandte Optimisierungsverfahren einzufügen. Allerdings besteht hier das Problem, dass ε einfach immer maximal groß gewählt wird

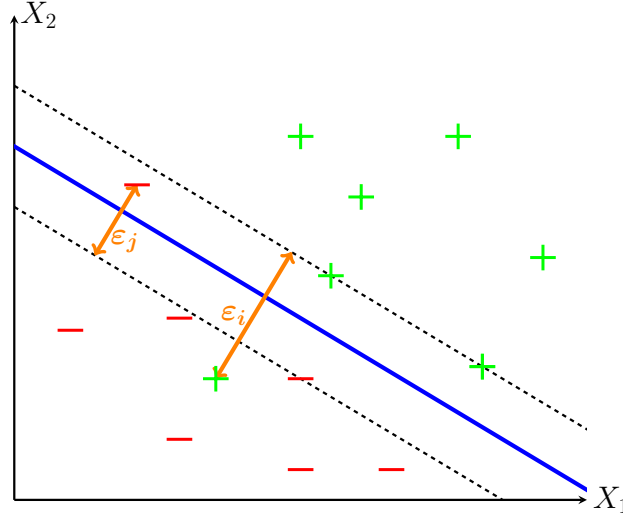


Abbildung 4: Funktion der Slack Variable

und so die Bedingung immer erfüllt wird. Um das Ausmaß der Verletzung der ursprünglichen Annahmen zu begrenzen, aber trotzdem noch gewisse Abweichung zuzulassen, wird ein weiterer Parameter C eingeführt, als regularisierender Parameter für ε . Leitet daraus zusammen mit der Restriktion $\varepsilon \geq 0$ wieder einen Lagrangefunktion her erhält man

$$\mathcal{L}(\bar{\beta}, \beta_0, \bar{\alpha}, \bar{\varepsilon}, \bar{\lambda}) = \frac{1}{2} \bar{\beta}' \cdot \bar{\beta} + C \sum_{i=1}^n \varepsilon_i - \underbrace{\sum \alpha_i [y_i (\bar{\beta} \cdot \bar{x}_i + \beta_0) - 1 + \varepsilon_i]}_{\text{für } y_i (\bar{\beta} \cdot \bar{x}_i - \beta_0) > 1 - \varepsilon_i} - \underbrace{\sum \lambda_i \varepsilon_i}_{\text{für } \varepsilon_i \geq 0} \quad (15)$$

Wenn dieser Ausdruck wie beim Hardmargin Classifier gelöst wird und die Ergebnisse eingesetzt werden erhält man wieder den Ausdruck aus (12) mit der zusätzlichen Einschränkung $0 \leq \alpha_i \leq C$. Dieses Maximierungsproblem wird dann genauso aufgelöst wie bei dem Hard Margin Classifier und die Entscheidungsregel ist ebenfalls gleich.

2.3 Der Kernel Trick

Auch wenn eine lineare Entscheidungsgrenze Vorteile in Sachen Generalisierbarkeit bietet, ist sie doch nicht für jede Datensituation geeignet. In Abbildung 5 ist es sehr gut zu erkennen, dass in diesem Fall eine lineare Grenze zwischen den Klassen keinen Sinn ergeben würde und eine elliptische Form wahrscheinlich besser geeignet wäre. Eine Lösung für dieses Problem, wäre den Merkmalsraum zu erweitern. So könnte die angenommene Formel für die lineare Hyperebene in (1) durch Polynomterme der Merkmale X_i oder durch Interaktionsterme erweitert werden. Dies führt dazu, dass die Entscheidungsgrenze in diesem vergrößerten Merkmalsraum immer noch linear ist, aber die Trennung möglich ist (siehe Abbildung 6). Transformiert man diese dann wieder in den ursprünglichen Merkmalsraum ist die Entscheidungsgrenze dann nicht mehr linear. Allerdings führt diese Herangehensweise zu einem starken Anstieg des Rechenaufwands, da die Möglichkeiten der Merkmalerweiterung endlos sind (James et al., 2021).

Die Lösung für das Problem sind sogenannte Kernel Funktionen. Betrachtet man die Entscheidungsfunktion (13) und setzt für $\bar{\beta}$ die Gleichung aus (10) erhält man

$$f(x_u) = \sum \alpha_i y_i x_i \cdot x_u + \beta_0 \quad (16)$$

Es zeigt sich also, dass die Entscheidungsfunktion im Wesentlichen aus einer Linearkombination von Punktprodukten aus dem Vektor x_u mit allen Trainingsvektoren x_i ergibt. Diese Punktprodukte kann als Ähnlichkeitsmaß zwischen dem neuen Datenpunkt und dem jeweiligen Trainingsdatenpunkt interpretiert werden. Es ist nun

Möglich diese Produkte durch eine Funktion zu ersetzen, welche die Ähnlichkeiten von Datenpunkten anders bewertet. Diese sogenannte Kernel Funktion $K(x_i, x_j)$ ermöglicht es eine flexiblere Entscheidungsgrenze zu implementieren. Der Vorteil ist dabei, dass die Kernel Funktion nur auf alle Punktprodukte angewendet wird und es dabei nicht nötig ist den Merkmalsraum zu Erweitern, was wiederum Rechenzeit spart (James et al., 2021). Die Entscheidungsfunktion wird dann mithilfe dieser Kernelfunktionen berechnet:

$$f(x_u) = \sum \alpha_i y_i K(x_i, x_u) + \beta_0 \quad (17)$$

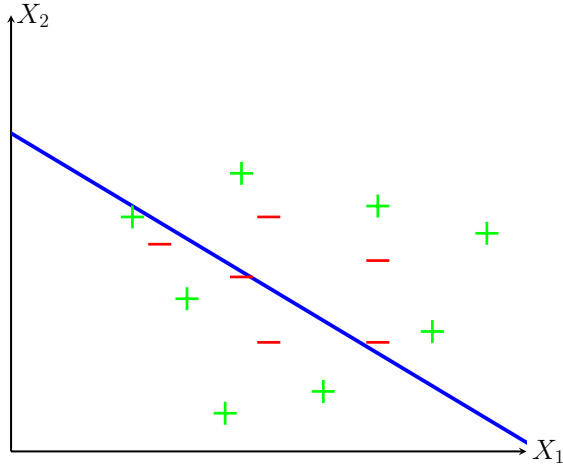


Abbildung 5: nicht linear getrennte Daten

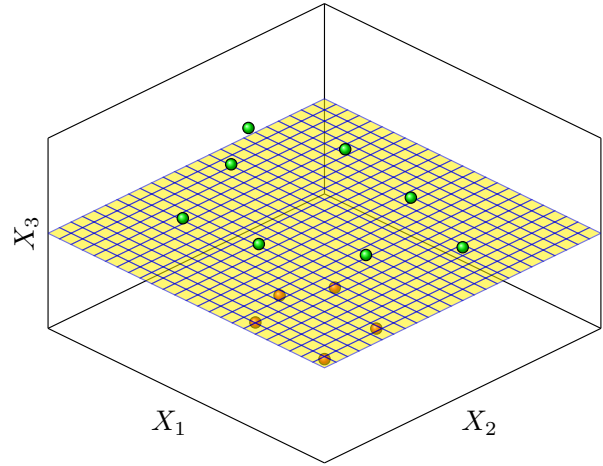


Abbildung 6: Feature Erweiterung

Es gibt eine ganze Reihe an Kernelfunktionen, die bei SVMs Anwendung finden. Die Grundlage ist der lineare Kernel, wobei dieser lediglich das Punktprodukt beschreibt, also praktisch genau das macht, was bei einer linearen Entscheidungsgrenze gemacht wird. Weiteren gibt es den Polynomial Kernel. Dieser hat die Form

$$K(x_i, x_u) = (1 + x_i \cdot x_u)^d \quad (18)$$

Die Verwendung von diesem Kernel führt dazu, dass die Entscheidungsgrenze sich ähnlich Verhält, wie als würde man zu Beginn eine Merkmalerweiterung mit Polynomen vom Grad d durchführen (siehe Abbildung 7). Eine weitere Kernel Funktion ist der Radial Basis Function Kernel (RBF) mit der Form

$$K(x_i, x_u) = \exp(-\gamma \|x_i - x_u\|^2) \quad (19)$$

Für diesen Kernel wird die quadrierte euklidische Distanz als Ähnlichkeitsmaß verwendet, was dazu führt, dass für diejenigen x_i die näher an x_u liegen, in der Entscheidungsfunktion einen größeren Einfluss haben. Der Parameter γ legt dann fest, wie stark der Einfluss der Distanz sein soll. Die Projektion die der Kernel hier macht ist eine, in einen unendlich großen Merkmalsraum. Daher könnte man selbst durch vorgeriges Erweitern des Merkmalsraums nicht das Ergebnis eines RBF Kernel replizieren und dies führt auch zu einer sehr flexiblen Entscheidungsgrenze (siehe Abbildung 8)

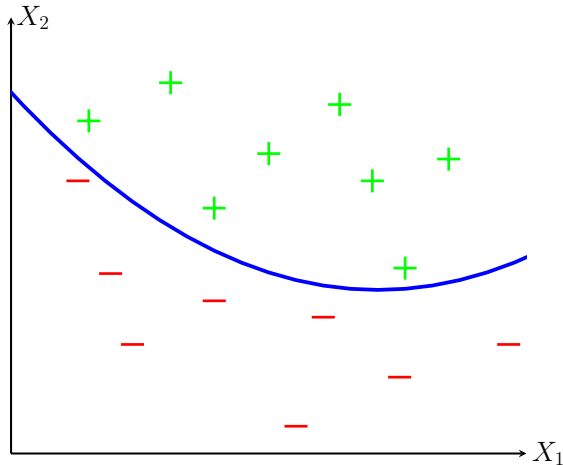


Abbildung 7: Mögliche Entscheidungsgrenze für polynomial Kernel

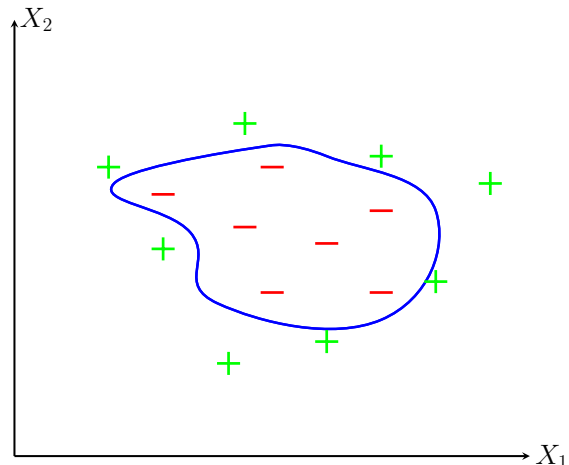


Abbildung 8: Mögliche Entscheidungsgrenze für RBF Kernel

Es gibt noch eine Reihe weiterer Kernel, die auf unterschiedlichen Ähnlichkeitsmaßen beruhen, aber eher seltener oder nur in speziellen Zusammenhängen angewendet werden. Wichtig ist anzumerken, dass die Verwendung von Kernels zwar die Flexibilität der Entscheidungsgrenze erhöht, damit aber auch die Gefahr von overfitting einhergeht. Zusätzlich werden mit den Kernels auch neue Hyperparameter wie d oder γ eingeführt, die bei der Model selection ebenfalls beachtet werden müssen.

3 Vor- und Nachteile der Methode

Support Vector Machines haben ein hohes Ansehen unter den Machine Learning Algorithmen, da sie einige Vorteile mit sich bringen. Aufgrund der Idee einer Soft Margin und des “Kernel Tricks” ist die Methode sehr flexibel und kann für spezielle Anwendungsbereiche angepasst werden (Bennett & Campbell, 2000). Dazu sind die Ergebnisse stabil und reproduzierbar, was sie von anderen Methoden wie beispielsweise Neural Networks abhebt. Auch die Anwendung ist vergleichsweise einfach, da es eine überschaubare Anzahl an Parametern gibt (wie beispielsweise bei der SVM mit radialem Kern nur der gamma- und cost-Parameter festzulegen ist). Durch die Möglichkeit der Nutzung verschiedener Kerne sind SVM’s überaus vielseitig. Die Auswahl des Kernels ermöglicht es äußerst flexible Entscheidungsgrenzen zu formen (Kuhn & Johnson, 2013). Dadurch können SVM’s an verschiedene Datensituationen angepasst werden.

Ein weiterer Vorteil ist, dass die Methode weitgehend robust gegenüber overfitting ist (Kuhn & Johnson, 2013). Dafür verantwortlich ist der Cost-Parameter, anhand dessen der Fit an die Daten kontrolliert werden kann. Jedoch birgt dies auch Probleme (Erläuterungen im folgenden Abschnitt).

Diese Vorteile resultieren in einer allgemein häufigen Nutzung von SVM’s in der Wissenschaft. Sie haben folglich bewiesen, dass sie für verschiedenste Aufgaben gut funktionieren (Kuhn & Johnson, 2013).

Trotz der vielfachen Nutzung von SVM’s, bringen sie auch Nachteile mit sich. Das wohl größte Problem liegt in der Modellselection (Bennett & Campbell, 2000). Wie bereits im vorherigen Abschnitt erwähnt, ist die Auswahl der Parameter von hoher Bedeutung bei der Performance und dem Fit an die Daten. So kontrollieren die kernspezifischen Parameter und der Cost-Parameter einerseits die Komplexität und andererseits den Fit an die Daten (Kuhn & Johnson, 2013). Dabei kann die Wahl der Parameter sowohl zu einem underfit als auch zu einem overfit führen. Jedoch haben nicht nur die Parameter einen Einfluss auf die Performance sondern bereits die Wahl des Kernels kann entscheidend sein (Burgess, 1998). Je nach Datensituation können SVM’s mit verschiedenen Kernen äußerst unterschiedliche Ergebnisse liefern. Dies zeigt die Sensitivität der Methode gegenüber der Wahl des Kernels und der Parameterabstimmung.

Ein weiterer Nachteil ist, dass die Methode weniger intuitiv und aufwendiger anzuwenden ist als andere Algorithmen (Bennett & Campbell, 2000). So ist es zum Beispiel schwer Informationen aus Support Vektoren

zu ziehen und es gibt keine Koeffizienten die interpretiert werden können.

Zuletzt ist zu erwähnen, dass die Methode bei einer hohen Anzahl an Beobachtungen besonders rechenintensiv ist. So konnte beispielsweise gezeigt werden, dass insbesondere die SVM mit polynomialem und radialem Kern eine hohe Rechenzeit aufweisen (Scholz & Wimmer, 2021). Dabei konnten andere Methoden wie die logistische Regression oder k-nearest Neighbour deutlich besser abschneiden. Dies liegt daran, dass die Lösung des SVM-Optimierungsproblems die Behebung eines quadratischen Programmierungsproblems erfordert. Da die Anzahl der zu optimierenden Parameter mit der Anzahl der Daten quadratisch zunimmt, führt dies zu einer hohen Rechenkomplexität (Kecman, 2005).

4 Daten

Das Ziel dieser Arbeit ist es, in verschiedenen Datensituationen die performance von SVM Algorithmen für die binäre Klassifikation zu evaluieren. Dafür wollen wir eine Reihe von Datensätzen mit verschiedenen Charakteristiken synthetisch erstellen und entsprechen als Trainingsdaten verwenden. Die Datensätze unterscheiden sich in zwei zentralen Eigenschaften. Das erste sind die Dimensionen. Es soll unterschieden werden in drei Kategorien. Die erste ist, dass es deutlich mehr Beobachtungen als Variablen gibt, also $n \gg p$. Ein solches Datenszenario kann z.B. im Kontext des Zensus auftreten, in dem eine große Anzahl an Personen befragt wird, aber die Vorgabe besteht, dass die Bürger nicht zu stark belastet werden sollen, weshalb nur einige wenige Kernfragen gestellt werden. Das zweite Szenario stellt Datensätze vor die etwa gleich viele Beobachtung wie Variablen haben $n \approx p$. Ein solches Szenario kann in vielen Kontexten auftreten. Das letzte Szenario behandelt dann entsprechend den Fall $n \ll p$. Dies tritt oft im Kontext von Datenerhebungen im medizinischen Bereich auf, da sehr viele Erhebungen zu kostspielig wären. Auch im Bereich des Natural Language Processing sind solche Datensätze häufiger anzutreffen (Scholz & Wimmer, 2021).

Die zweite Charakteristik ist der Datengenerierende Prozess. Da in dieser Arbeit SVMs im Vordergrund stehen und wir hier vor allem Zeigen wollen, wie SVMs funktionieren, wird der DGP so aufgebaut, dass er der grundlegenden Idee der SVMs am ehesten Entspricht. Die Vorgehensweise ist, im ersten Schritt eine Hyperplane, im p -Dimensionalen Raum, in einer bestimmte Form zu erstellen und anschließend auf jeweils einer Seite dieser Hyperplane $n/2$ zufällige Punkte zu sampeln, die die jeweilige Ausprägung in der Zielvariable repräsentieren.

Insgesamt gibt es auch hier wieder 3 Kategorien. Die erste sind linear getrennte Daten. Dafür wird eine lineare Hyperplane der Form

$$\beta_0 + \beta_1 X_1 + \beta_2 X_2 + \dots + \beta_p X_p = 0$$

mit zufälligen Koeffizienten erzeugt. Diese Daten sollen also den Annahmen entsprechen, die für SVMs mit linearem Kernel gelten. Nachdem für eine Beobachtung j zufällig ein Punkt auf der Ebene gesampelt wurde, wurde dieser anschließend verschoben. Die Verschiebung erfolgte über eine Skalierung des normierten Normalenvektors $k \left(\frac{\vec{\beta}}{\|\vec{\beta}\|} \right)$. k ist dabei eine Zufallszahl mit Mittelwert μ_k und Varianz σ_k^2 . Dieser Prozess wird $n/2$ mal wiederholt für die eine Ausprägung der Zielvariable und dementsprechen $n/2$ mal für die andere Ausprägung, dann aber mit $-\mu_k$ als Mittelwert für k .

In der zweiten Situation hat die Hyperplane eine quadratische Form:

$$\beta_0 + \beta_1 X_1 + \beta_2 X_1^2 + \beta_3 X_2 + \beta_4 X_2^2 + \dots + \beta_{2p-1} X_p + \beta_{2p} X_p^2 = 0$$

diese Form der Trennung stellt also eine Merkmalserweiterung um quadratische Terme dar und funktioniert damit ähnlich wie eine SVM mit polynomialen Kernel mit $d = 2$. Der letzte DGP geht von einer noch komplexeren Entscheidungsgrenzen aus. Es wird hier ein Hypersphäre im p dimensionalen Raum erstellt und einmal innerhalb und einmal außerhalb dieser gesampelt. Dafür wurde für eine Beobachtung j , $p - 1$ Winkel θ zufällig erstellt, ein Radius r festgelegt und anschließend die einzelnen Werte $X_{1,j}, X_{2,j}, \dots, X_{p,j}$ berechnet.

Die Berechnung erfolgt dabei über die Definition von sphärischen Koordinaten:

$$\begin{aligned}
X_{1,j} &= r \cos(\theta_1) \\
X_{2,j} &= r \sin(\theta_1) \cos(\theta_2) \\
X_{3,j} &= r \sin(\theta_1) \sin(\theta_2) \cos(\theta_3) \\
&\vdots \\
X_{p-1,j} &= r \sin(\theta_1) \dots \sin(\theta_{p-2}) \cos(\theta_{p-1}) \\
X_{p,j} &= r \sin(\theta_1) \dots \sin(\theta_{p-2}) \sin(\theta_{p-1})
\end{aligned}$$

Dieser Vorgang wird dann $n/2$ mal, mit einem zufälligen Radius mit Mittelwert μ_r und einer Varianz σ_r^2 für die eine Ausprägung der Zielvariable wiederholt. Für die andere Ausprägung wurde das gleiche dann durchgeführt mit einem neuen Mittelwert $\mu_r + k, k \in \mathbb{R}$. je nachdem wie k und σ_r^2 gewählt werden kann die Trennbarkeit der Daten angepasst werden.

Es ergeben sich daher 9 unterschiedliche Datensituationen, welche in ihren Dimensionen und Komplexität der Entscheidungsgrenze variieren. Die Kürzel für die Situationen sind in Tabelle 1 abgetragen

	linear	polynomial	radial
$p \ll n$	S1	S2	S3
$p \approx n$	S4	S5	S6
$p \gg n$	S7	S8	S9

Tabelle 1: Datensituationen

Zusätzlich soll nicht nur ein Vergleich zwischen der Performance der SVMS mit verschiedenen Kernel gemacht werden, sondern auch die Unterschiede in der Klassifikationsgüte der SVMs zu anderen gängigen Klassifikationsmethoden gezeigt werden. Dafür werden Regularized Logistic Regression und k-nearest Neighbour als Vergleichsalgorithmen hinzugezogen.

5 Hypothesen

Im Folgenden werden Studien hinzugezogen, um eine Einschätzung der Performance in den verschiedenen Szenarien vorzunehmen und Hypothesen abzuleiten. Vorab ist zu erwähnen, dass die Evaluation von Klassifikationsmethoden anhand synthetischer Datensätze in der Literatur begrenzt ist. Da für diese Arbeit die Form der Entscheidungsgrenze entscheidend ist, werden dennoch ausschließlich Arbeiten mit synthetischen Datensätzen zu Rate gezogen.

Aufgrund dessen, dass der Datengenerierende Prozess hier so ausgearbeitet wurde, dass er mit den Annahmen der SVMs arbeitet, erwarten wir zuerst einmal eine bessere Performance der SVM Classifier im Vergleich zu den anderen Methoden.

H1: Die SVM Classifier Performen über alle Datensituationen im Durchschnitt besser als die anderen Classifier

Des Weiteren wurden in den einzelnen Kategorien des daten generierenden Prozesses die Entscheidungsgrenzen speziell auf verschiedene Kernels der SVMs zugeschnitten. Daher sollten SVMs mit linearem Kernel im Setting mit linearer Entscheidungsgrenze mindestens so gut oder besser als die restlichen Classifier performen. Gleiches gilt für SVMs mit polynomialen Kernel im Setting mit einer quadratischen Entscheidungsgrenze und radiale Kernel bei einer Hypersphäre als Entscheidungsgrenze.

H2: Die SVM Classifier mit dem Kernel, der für die jeweiligen DGP zugeschnitten ist sollten mindestens genauso gut oder besser Performen als die restlichen Classifier

Es konnte weiterhin gezeigt werden, dass in einem Szenario, indem erheblich mehr Beobachtungen als Dimensionen und eine lineare Entscheidungsgrenze vorliegen (S1), deutliche Unterschiede zwischen SVM, k-NN und logistischer Regression bei der Diskriminationsfähigkeit auftreten (Entezari-Maleki et al., 2009).

k-NN und lineare SVM zeigen AUC-Werte nahe 1 auf, was für eine nahezu perfekte Differenzierung der Klassen spricht. Die logistische Regression hingegen hat einen Wert knapp über 0.5, was nur etwas besser als eine Zufallsauswahl ist. Darüber hinaus ist festzustellen, dass die Unterschiede deutlicher werden, je höher die Anzahl an Beobachtungen ist.

Für den Fall einer radialen Entscheidungsgrenze (S3) sind die Ergebnisse ähnlich. So erreicht in diesem Beispiel eine SVM mit radialem Kernel im Vergleich zu einer logistischen Regression eine um 34% höhere Genauigkeit (Fávero et al., 2022).

Die Szenarien S4 bis S6 finden in der Literatur kaum Beachtung, weshalb hier keine Studien herangezogen werden können. Liegt jedoch ein Szenario vor, indem die Anzahl der Dimensionen erheblich größer ist, als die Anzahl der Beobachtungen, mit einer linearen Entscheidungsgrenze (S7), sind die Ergebnisse differenzierter zu betrachten. So schneidet die SVM mit polynomialem Kern am besten unter den genannten Algorithmen ab, jedoch die lineare SVM am schlechtesten (als Kriterium wurde die mittlere Performance über 100 Datensätze evaluiert) (Scholz & Wimmer, 2021). Während k-NN auch in diesem Szenario eine gute Performance hat, schneiden logistische Regression und SVM mit radialem Kern mittelmäßig ab. Hierbei ist wichtig zu erwähnen, dass in der Studie keine Ergebnisse über die genaue Performance präsentiert wurden, sondern lediglich die Ränge der 25 behandelten Klassifikationsmethoden. Somit können nur eingeschränkte Schlussfolgerungen gezogen werden.

Basierend auf den Ergebnissen der genannten Studien können folgende Schlussfolgerungen gezogen werden.

H3: In niedrigdimensionalen Szenarien performen k-NN und SVM's besser als eine logistische Regression.

Jedoch ist zu vermuten, dass die Wahl des Kerns bei SVM's einen großen Einfluss auf die Performance hat. So ist, basierend auf den mathematischen Grundlagen, anzunehmen, dass die SVM mit dem jeweils passenden Kern zu der vorliegenden Datensituation am besten performt. Da die SVM mit polynomialem und radialem Kern weitaus flexibler sind, werden diese voraussichtlich insgesamt betrachtet besser abschneiden als die SVM mit linearem Kern.

In hochdimensionalen Szenarien zeigt vermutlich die SVM mit polynomialem oder radialem Kern eine gute Performance, unabhängig von der Form der Entscheidungsgrenze, während die lineare SVM voraussichtlich weniger gut abschneiden wird. Es scheint so, dass auch k-NN und logistische Regression in hochdimensionalen Szenarien zumindest mittelmäßig abschneiden. Es ist aber auch bekannt, dass gerade die k-NN Methode in hochdimensionalen Settings schlechter performt (James et al., 2021). Hier ist jedoch zu beachten, dass nur eine lineare Entscheidungsgrenze betrachtet wurde und in den Szenarien S8 und S9 andere Ergebnisse möglich sind. Wir schließen Final daraus:

H4: In hochdimensionalen Settings performen v.a. SVMs mit radialen und polynomialen Kernel besser als die anderen Klassifikationsmethoden

6 Ergebnisse

6.1 Analyse

Bevor die Ergebnisse dargelegt werden, wird kurz auf die Vorgehensweise bei der Analyse eingegangen. In die Analyse werden fünf Modelle einbezogen: SVM mit linearem, polynomialem und radialem Kern, sowie regularisierte logistische Regression und k-nearest neighbours.

Vor dem Erstellen der Modelle wird ein Tuning der Hyperparameter je Modell durchgeführt. Dafür wird die Bayesian Optimization Methode genutzt, welche ein iterativer Algorithmus ist. Hierbei werden die nächsten Evaluierungspunkte basierend auf zuvor beobachteten Ergebnissen bestimmt (Yang & Shami, 2020). Der Algorithmus basiert auf zwei Hauptkomponenten: einem Surrogatmodell und einer Akquisitionsfunktion. Das Surrogatmodell, wofür hier ein Gaussian Process genutzt wird, passt die bisher beobachteten Punkte an die Zielfunktion an. Die Akquisitionsfunktion wählt dann die nächsten Punkte aus, wobei ein Gleichgewicht zwischen der Erkundung neuer Bereiche und der Nutzung vielversprechender Regionen angestrebt wird. Dafür wird hier der Ansatz des Upper-Confidence-Bound genutzt, welcher obere Konfidenzgrenzen nutzt um den Verlust gegenüber der besten möglichen Entscheidung, während der Optimierung zu minimieren (Snoek et al.,

2012). Die Bayesian Optimization wird genutzt, da sie eine schnelle Konvergenz für stetige Hyperparameter aufweist (Yang & Shami, 2020). Als Evaluierungskriterium wird die Genauigkeit der Modelle, welche durch den Anteil der korrekt klassifizierten Beobachtungen wiedergegeben wird, verwendet.

Basierend auf den Ergebnissen des Tuning werden die oben genannten Modelle erstellt. Daraufhin werden die Genauigkeit und die Receiver Operating Characteristic Kurve (ROC-Kurve) bzw. der Area Under The Curve Wert (AUC-Wert) für jedes Modell bestimmt. Die ROC-Kurve ist eine grafische Darstellung der Leistungsfähigkeit eines Klassifikationsmodells, wobei die Sensitivität gegen die Spezifität abgetragen wird (Fawcett, 2006). Die Sensitivität gibt den Anteil der korrekt als positiv (hier gleichbedeutend mit Klasse 1) klassifizierten Beobachtungen an während die Spezifität den Anteil der korrekt als negativ (hier gleichbedeutend mit Klasse 2) klassifizierten Beobachtungen angibt. Der AUC-Wert bezieht sich auf die Fläche unterhalb der Kurve und liegt somit im Intervall $[0,1]$, wobei ein Wert von 1 für eine perfekte Klassifikation spricht, während ein Wert von 0.5 für eine rein zufällige Zuordnung der Klassen spricht.

6.2 Auswertung

Literatur

- Bennett, K., & Campbell, C. (2000). Support Vector Machines: Hype or Hallelujah? *ACM SIGKDD Explorations Newsletter*, 2, 1–13. <https://doi.org/10.1145/380995.380999>
- Boser, B. E., Guyon, I. M., & Vapnik, V. N. (1992). A training algorithm for optimal margin classifiers. *Proceedings of the Fifth Annual Workshop on Computational Learning Theory*, 144–152. <https://doi.org/10.1145/130385.130401>
- Burges, C. J. (1998). A Tutorial on Support Vector Machines for Pattern Recognition. *Data Mining and Knowledge Discovery*, 2(2), 121–167. <https://doi.org/10.1023/A:1009715923555>
- Entezari-Maleki, R., Rezaei, A., & Minaei-Bidgoli, B. (2009). Comparison of Classification Methods Based on the Type of Attributes and Sample Size. *Journal of Convergence Information Technology*, 4(3), 94–102. <https://doi.org/10.4156/jcit.vol4.issue3.14>
- Fávero, L. P., Belfiore, P., Santos, H. P., dos Santos, M., de Araújo Costa, I. P., & Junior, W. T. (2022). Classification Performance Evaluation from Multilevel Logistic and Support Vector Machine Algorithms through Simulated Data in Python. *Procedia Computer Science*, 214, 511–519. <https://doi.org/10.1016/j.procs.2022.11.206>
- Fawcett, T. (2006). An Introduction to ROC Analysis. *Pattern Recognition Letters*, 27(8), 861–874. <https://doi.org/10.1016/j.patrec.2005.10.010>
- James, G., Witten, D., Hastie, T., & Tibshirani, R. (2021). *An Introduction to Statistical Learning: With Applications in R*. Springer US. <https://doi.org/10.1007/978-1-0716-1418-1>
- Kecman, V. (2005, April). Support Vector Machines – An Introduction. In J. Kacprzyk & L. Wang (Hrsg.), *Support Vector Machines: Theory and Applications* (S. 1–47, Bd. 177). Springer Berlin Heidelberg. https://doi.org/10.1007/10984697_1
- Kuhn, M., & Johnson, K. (2013). *Applied Predictive Modeling*. Springer New York. <https://doi.org/10.1007/978-1-4614-6849-3>
- Scholz, M., & Wimmer, T. (2021). A Comparison of Classification Methods across Different Data Complexity Scenarios and Datasets. *Expert Systems with Applications*, 168, 114217. <https://doi.org/10.1016/j.eswa.2020.114217>
- Snoek, J., Larochelle, H., & Adams, R. P. (2012, August). Practical Bayesian Optimization of Machine Learning Algorithms.
- Yang, L., & Shami, A. (2020). On Hyperparameter Optimization of Machine Learning Algorithms: Theory and Practice. *Neurocomputing*, 415, 295–316. <https://doi.org/10.1016/j.neucom.2020.07.061>