

19

Canonical Correlation Analysis

典型相关分析

找到两组数据的整体相关性的最大线性组合



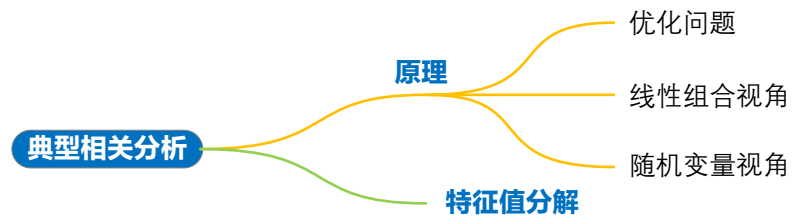
人类生而好奇，这正是科学的火种。

Men love to wonder, and that is the seed of science.

—— 拉尔夫·爱默生 (Ralph Waldo Emerson) | 美国思想家、文学家 | 1803 ~ 1882



- numpy.linalg.eig() 特征值分解
- numpy.linalg.inv() 矩阵求逆
- seaborn.heatmap() 绘制 heatmap
- seaborn.jointplot() 绘制散点图，含边缘分布
- seaborn.pairplot() 成对散点图
- seaborn.scatterplot() 绘制散点图
- sklearn.cross_decomposition.CCA() 典型相关分析



19.1 典型相关分析原理

典型相关分析 (Canonical Correlation Analysis, CCA) 是一种用于探究两组变量之间关系的多元统计分析方法。其核心思想是将两组变量分别投影到新的低维空间中，使得这两组变量在新空间中的投影尽可能相关。

CCA 常用于处理两组多元变量之间的关系。通过 CCA 可以发现这两组变量中的某些维度之间存在相关性，这种相关性可以帮助研究者更好地理解两组变量之间的关系。

使用 CCA 时，一般需要先对两组变量进行标准化处理，然后计算它们的相关系数矩阵。接着，CCA 会生成一组线性组合，使得两组变量在新的低维空间中的投影尽可能相关。这些线性组合称为典型变量，相关系数则称为典型相关系数。最终的结果是一组典型变量和对应的典型相关系数。

原理

下面以 \mathbf{X} 和 \mathbf{Y} 为例介绍典型相关分析原理。

$n \times p$ 数据矩阵 \mathbf{X} 可以写成：

$$\mathbf{X}_{n \times p} = [\mathbf{x}_1 \quad \mathbf{x}_2 \quad \cdots \quad \mathbf{x}_p] \quad (1)$$

$n \times q$ 数据矩阵 \mathbf{Y} 可以写成：

$$\mathbf{Y}_{n \times q} = [\mathbf{y}_1 \quad \mathbf{y}_2 \quad \cdots \quad \mathbf{y}_q] \quad (2)$$

⚠ 注意， \mathbf{X} 和 \mathbf{Y} 的行数一致。

\mathbf{X} 朝向量 \mathbf{u}_1 投影结果为 \mathbf{s}_1 ：

$$\mathbf{s}_1 = \mathbf{X}_{n \times p} \mathbf{u}_1 \quad (3)$$

其中， \mathbf{u}_1 的形状为 $p \times 1$ ， \mathbf{s}_1 的形状为 $n \times 1$ 。

⚠ 注意，很多参考文献中，向量一般记做 \mathbf{a} 和 \mathbf{b} ，投影结果一般记做 \mathbf{u} 和 \mathbf{v} ；但是本书 \mathbf{u} 和 \mathbf{v} 特指代表投影方向的向量，所以本章依然沿用这种记法。

展开 (3) 得到如下线性组合形式：

$$\mathbf{s}_1 = [\mathbf{x}_1 \quad \mathbf{x}_2 \quad \cdots \quad \mathbf{x}_p] \begin{bmatrix} u_{1,1} \\ u_{2,1} \\ \vdots \\ u_{p,1} \end{bmatrix} = u_{1,1} \mathbf{x}_1 + u_{2,1} \mathbf{x}_2 + \cdots + u_{p,1} \mathbf{x}_p \quad (4)$$

\mathbf{Y} 朝向量 \mathbf{v}_1 投影结果为 \mathbf{t}_1 ：

$$\mathbf{t}_1 = \mathbf{Y}_{n \times q} \mathbf{v}_1 \quad (5)$$

其中， \mathbf{v}_1 的形状为 $q \times 1$ ， \mathbf{t}_1 的形状为 $n \times 1$ 。 p 和 q 可以不相等，也就是说 \mathbf{u}_1 、 \mathbf{v}_1 形状可能不同。但是 \mathbf{s}_1 、 \mathbf{t}_1 形状相同。

展开 (5) 得到如下线性组合形式：

本 PDF 文件为作者草稿，发布目的为方便读者在移动终端学习，终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。

版权归清华大学出版社所有，请勿商用，引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载：<https://github.com/Visualize-ML>

本书配套微视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger：<https://space.bilibili.com/513194466>

欢迎大家批评指教，本书专属邮箱：jiang.visualize.ml@gmail.com

$$\mathbf{t}_1 = [\mathbf{y}_1 \quad \mathbf{y}_2 \quad \cdots \quad \mathbf{y}_q] \begin{bmatrix} v_{1,1} \\ v_{2,1} \\ \vdots \\ v_{q,1} \end{bmatrix} = v_{1,1}\mathbf{y}_1 + v_{2,1}\mathbf{y}_2 + \cdots v_{q,1}\mathbf{y}_q \quad (6)$$

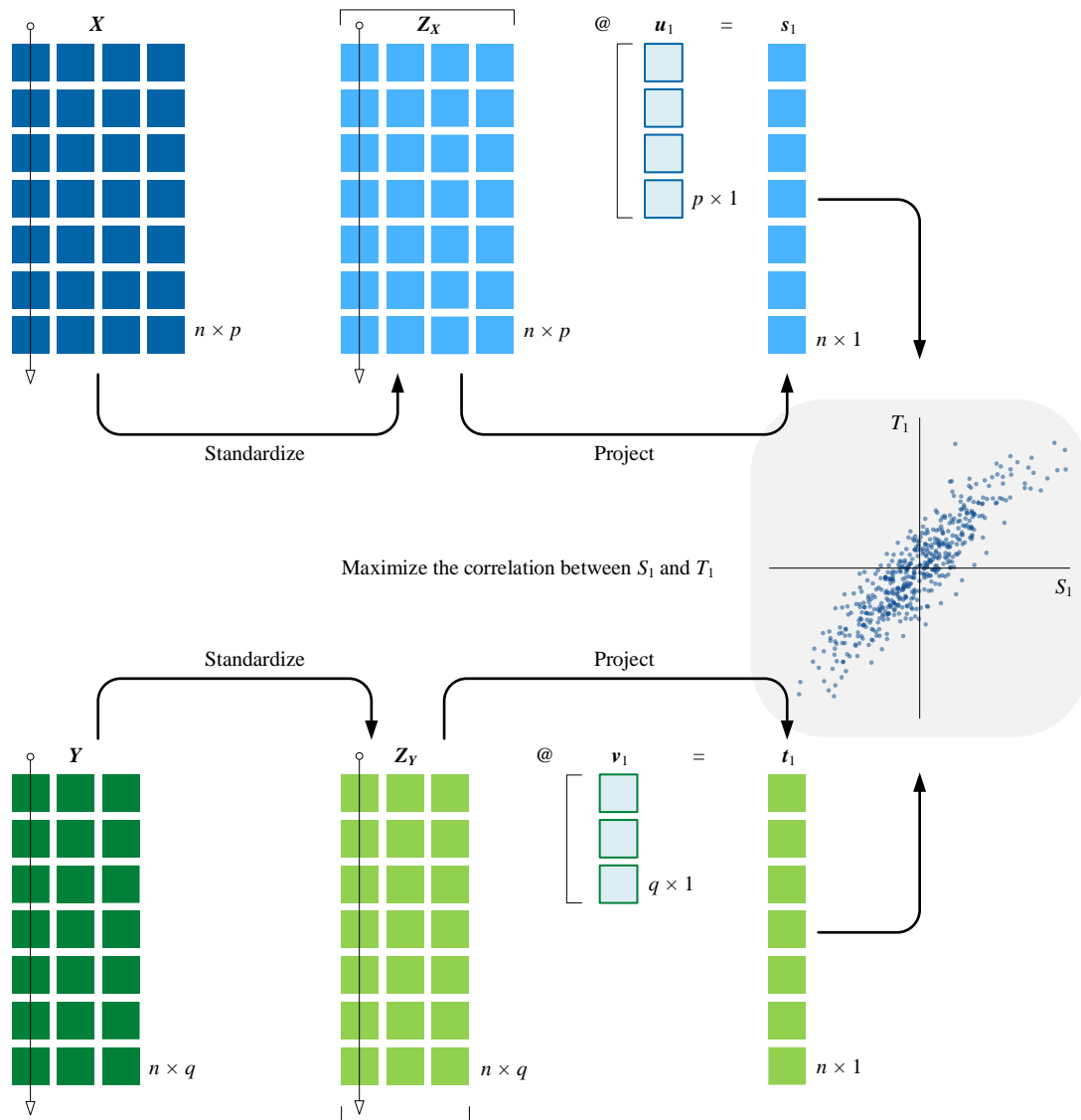


图 1. 典型相关分析原理

优化问题

如图 1 所示，典型相关分析 CCA 的问题便是找到 u_1 和 v_1 ，使得 s_1 和 t_1 相关性最大。

⚠ 注意，如图 1 所示，从数据角度来看，一般情况 X 和 Y 都先经过标准化处理。

随机变量

用随机变量来写的话， S_1 对应 s_1 ， T_1 对应 t_1 。随机变量 S_1 可以写成如下线性变换：

$$S_1 = \mathbf{u}_1^T \mathbf{X} = \begin{bmatrix} u_{1,1} & u_{2,1} & \cdots & u_{p,1} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} X_1 \\ X_2 \\ \vdots \\ X_p \end{bmatrix} = u_{1,1}X_1 + u_{2,1}X_2 + \cdots + u_{p,1}X_p \quad (7)$$

同理，随机变量 T_1 可以写成：

$$T_1 = \mathbf{v}_1^T \mathbf{Y} = \begin{bmatrix} v_{1,1} & v_{2,1} & \cdots & v_{q,1} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} Y_1 \\ Y_2 \\ \vdots \\ Y_q \end{bmatrix} = v_{1,1}Y_1 + v_{2,1}Y_2 + \cdots + v_{q,1}Y_q \quad (8)$$

S_1 和 T_1 是**第一对典型变量** (first pair of canonical variables)。

S_1 和 T_1 的相关性系数为：

$$\text{corr}(S_1, T_1) = \frac{\text{cov}(S_1, T_1)}{\sqrt{\text{var}(S_1)} \sqrt{\text{var}(T_1)}} \quad (9)$$

这样寻找第一对典型变量的优化问题可以写成：

$$\underset{\mathbf{u}_1, \mathbf{v}_1}{\text{argmax}} \text{corr}(S_1, T_1) \quad (10)$$



有关随机变量的线性变换，请大家回顾《统计至简》第 14 章。

寻找更多典型变量

如图 2 所示，再找到第一对典型变量之后，依然最大化相关性系数可以找到**第二对典型变量** (second pair of canonical variables)。约束条件是第一、第二对典型变量不相关。

用向量来写， s_2 也是 $\begin{bmatrix} \mathbf{x}_1 & \mathbf{x}_2 & \cdots & \mathbf{x}_p \end{bmatrix}$ 的线性组合：

$$s_2 = \mathbf{X} \mathbf{u}_2 = \begin{bmatrix} \mathbf{x}_1 & \mathbf{x}_2 & \cdots & \mathbf{x}_p \end{bmatrix} \begin{bmatrix} u_{1,2} \\ u_{2,2} \\ \vdots \\ u_{p,2} \end{bmatrix} = u_{1,2}\mathbf{x}_1 + u_{2,2}\mathbf{x}_2 + \cdots + u_{p,2}\mathbf{x}_p \quad (11)$$

上式相当于 \mathbf{X} 朝 \mathbf{u}_2 投影。

t_2 为 $\begin{bmatrix} \mathbf{y}_1 & \mathbf{y}_2 & \cdots & \mathbf{y}_q \end{bmatrix}$ 的线性组合：

$$t_2 = \begin{bmatrix} \mathbf{y}_1 & \mathbf{y}_2 & \cdots & \mathbf{y}_q \end{bmatrix} \begin{bmatrix} v_{1,2} \\ v_{2,2} \\ \vdots \\ v_{q,2} \end{bmatrix} = v_{1,2}\mathbf{y}_1 + v_{2,2}\mathbf{y}_2 + \cdots + v_{q,2}\mathbf{y}_q \quad (12)$$

上式相当于 \mathbf{Y} 朝 \mathbf{v}_2 投影。

通过最大化的 s_2 和 t_2 相关性系数，可以找到第二对典型变量。这步优化问题的约束条件为：

本 PDF 文件为作者草稿，发布目的为方便读者在移动终端学习，终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。

版权归清华大学出版社所有，请勿商用，引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载：<https://github.com/Visualize-ML>

本书配套微视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger：<https://space.bilibili.com/513194466>

欢迎大家批评指教，本书专属邮箱：jiang.visualize.ml@gmail.com

$$\begin{aligned}
 \mathbf{u}_1^T \mathbf{u}_2 &= 0 \\
 \mathbf{v}_1^T \mathbf{v}_2 &= 0 \\
 \mathbf{u}_1^T \mathbf{v}_2 &= 0 \\
 \mathbf{v}_1^T \mathbf{u}_2 &= 0
 \end{aligned} \tag{13}$$

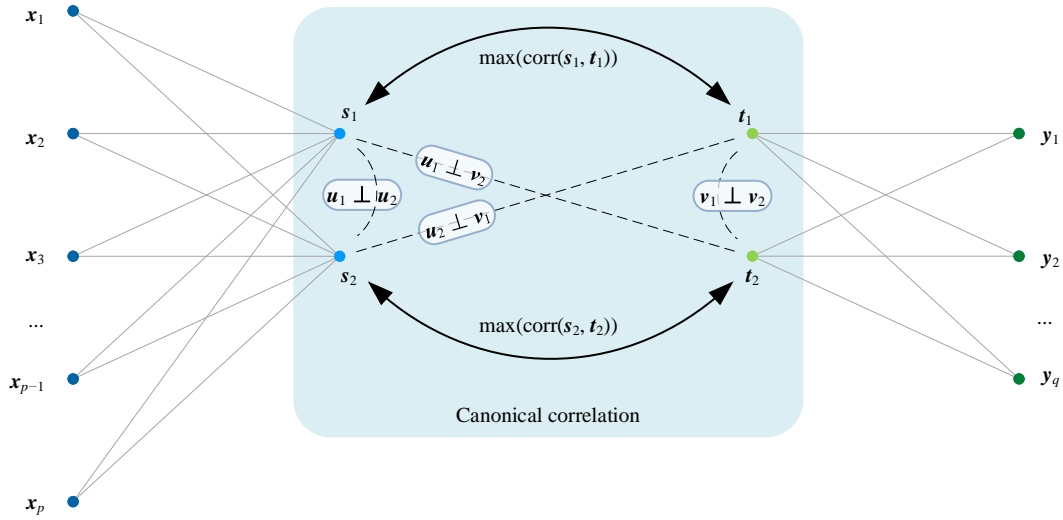


图 2. 线性组合角度看 CCA

随机变量 S_2 可以写成：

$$S_2 = \mathbf{u}_2^T \mathbf{X} = \begin{bmatrix} u_{1,2} & u_{2,2} & \cdots & u_{p,2} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} X_1 \\ X_2 \\ \vdots \\ X_p \end{bmatrix} = u_{1,2}X_1 + u_{2,2}X_2 + \cdots + u_{p,2}X_p \tag{14}$$

随机变量 T_2 可以写成：

$$T_2 = \mathbf{v}_2^T \mathbf{Y} = \begin{bmatrix} v_{1,2} & v_{2,2} & \cdots & v_{q,2} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} Y_1 \\ Y_2 \\ \vdots \\ Y_q \end{bmatrix} = v_{1,2}Y_1 + v_{2,2}Y_2 + \cdots + v_{q,2}Y_q \tag{15}$$

考虑到一般情况下 \mathbf{X} 和 \mathbf{Y} 已经标准化， $E(\mathbf{X}) = \mathbf{0}$ 且 $E(\mathbf{Y}) = \mathbf{0}$ 。这样 $E(U_1) = 0$ ， $E(V_1) = 0$ 。

这个步骤最多重复 $\min(p, q)$ 次，可以最多找到 $\min(p, q)$ 对典型变量。 $\min(p, q)$ 对应 \mathbf{X} 和 \mathbf{Y} 的列数最小值。

19.2 从一个协方差矩阵考虑

$[\mathbf{X}, \mathbf{Y}]$ 的协方差矩阵可以按图 3 所示形式分成四个子块。 Σ_{xx} 为 \mathbf{X} 的协方差矩阵， Σ_{yy} 为 \mathbf{Y} 的协方差矩阵，它俩都是方阵。 Σ_{xy} 、 Σ_{yx} 都是 \mathbf{X} 、 \mathbf{Y} 的互协方差矩阵 (cross-covariance matrix)，它俩互为转置。

本 PDF 文件为作者草稿，发布目的为方便读者在移动终端学习，终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。

版权归清华大学出版社所有，请勿商用，引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载：<https://github.com/Visualize-ML>

本书配套微课视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger：<https://space.bilibili.com/513194466>

欢迎大家批评指教，本书专属邮箱：jiang.visualize.ml@gmail.com



《统计至简》第 13 章特别介绍过协方差矩阵分块，请大家回顾。

S_1 和 T_1 各自的方差、协方差为：

$$\begin{aligned}\text{var}(S_1) &= \mathbf{u}_1^T \boldsymbol{\Sigma}_{XX} \mathbf{u}_1 \\ \text{var}(T_1) &= \mathbf{v}_1^T \boldsymbol{\Sigma}_{YY} \mathbf{v}_1 \\ \text{cov}(S_1, T_1) &= \mathbf{u}_1^T \boldsymbol{\Sigma}_{XY} \mathbf{v}_1\end{aligned}\tag{16}$$



如果大家对上式概念模糊的话，请回顾《统计至简》第 14 章。

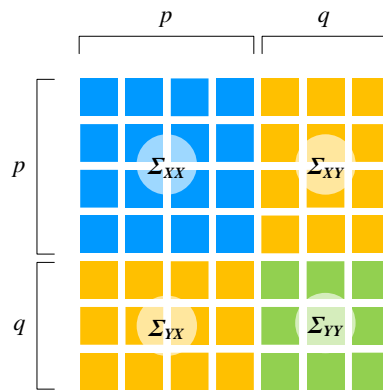


图 3. $[X, Y]$ 的协方差矩阵分块

这样，(9) 的相关性系数可以写成：

$$\text{corr}(S_1, T_1) = \frac{\mathbf{u}_1^T \boldsymbol{\Sigma}_{XY} \mathbf{v}_1}{\sqrt{\mathbf{u}_1^T \boldsymbol{\Sigma}_{XX} \mathbf{u}_1} \sqrt{\mathbf{v}_1^T \boldsymbol{\Sigma}_{YY} \mathbf{v}_1}}\tag{17}$$

观察上式，大家是否发现它实际上是个瑞利商 (Rayleigh quotient)。



我们在《矩阵力量》第 14 章了解过瑞利商。

优化结果

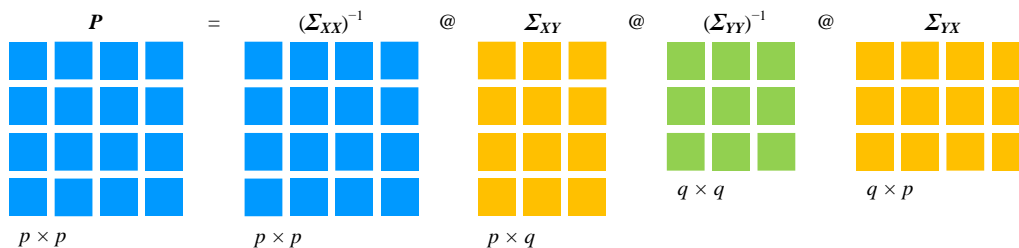
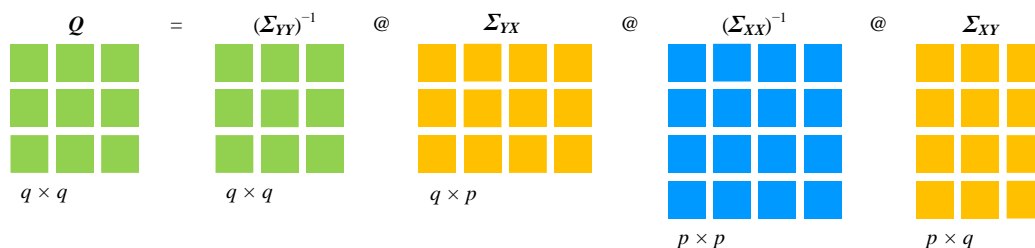
利用拉格朗日乘子法，我们可以求得优化问题的解。此处，省略推导过程，直接给出结果。

向量 \mathbf{u} 是 $\mathbf{P} = \boldsymbol{\Sigma}_{XX}^{-1} \boldsymbol{\Sigma}_{XY} \boldsymbol{\Sigma}_{YY}^{-1} \boldsymbol{\Sigma}_{YX}$ 的特征向量。如图 4 所示， \mathbf{P} 为 $p \times p$ 方阵。

向量 \mathbf{v} 是 $\mathbf{Q} = \boldsymbol{\Sigma}_{YY}^{-1} \boldsymbol{\Sigma}_{YX} \boldsymbol{\Sigma}_{XX}^{-1} \boldsymbol{\Sigma}_{XY}$ 的特征向量。如图 5 所示， \mathbf{Q} 为 $q \times q$ 方阵。

值得大家注意的是，如图 1 所示，一般 CCA 算法中，数据先要经过标准化处理。也就是说图 3 中真正参与运算的是相关性系数矩阵，而非协方差矩阵。

本章下面要使用的 `sklearn.cross_decomposition.CCA()` 函数就是先对数据标准化，再进行 CCA 分析。

图 4. $\Sigma_{XX}^{-1} \Sigma_{XY} \Sigma_{YY}^{-1} \Sigma_{YX}$ 对应运算图 5. $\Sigma_{YY}^{-1} \Sigma_{YX} \Sigma_{XX}^{-1} \Sigma_{XY}$ 对应运算

19.3 以鸢尾花数据为例

本节以鸢尾花数据为例介绍如何完成典型相关分析。

如所示，我们把鸢尾花数据 4 列均分为 X 和 Y 两个矩阵。 X 代表花萼 (长度、宽度)， Y 代表花瓣 (长度、宽度)。

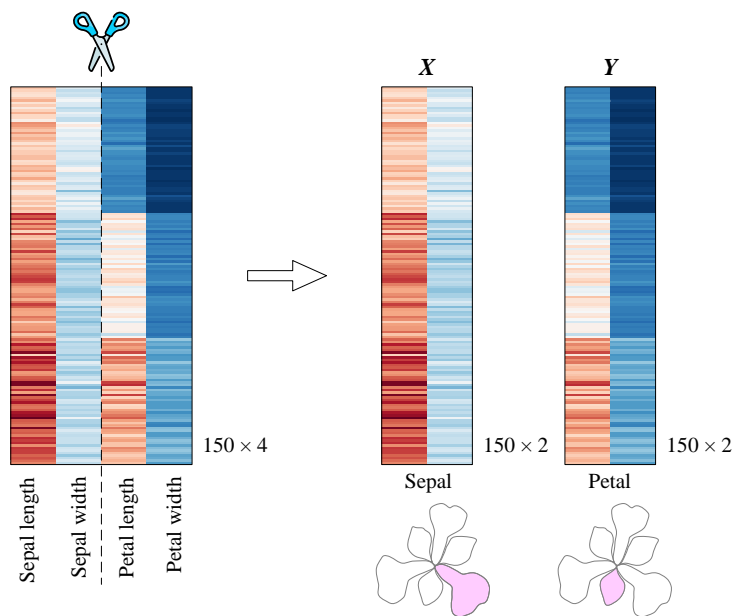


图 6. 把鸢尾花数据均分成两个子块

典型相关分析就是，将花萼数据 X 的两列合成一列 s_1 ，将花瓣数据 Y 的两列合成一列 t_1 。通过合适的组合方式，让 s_1 和 t_1 的相关性最大。可以理解为找到花萼、花瓣之间“整体”关系。

图 7 所示为鸢尾花数据的相关性系数矩阵。请大家特别关注热图中黄色框高亮的两个子块，花萼和花瓣之间最大的相关性存在于花萼长度和花瓣长度 (0.87)。

本 PDF 文件为作者草稿，发布目的为方便读者在移动终端学习，终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。

版权归清华大学出版社所有，请勿商用，引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载：<https://github.com/Visualize-ML>

本书配套微课视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger: <https://space.bilibili.com/513194466>

欢迎大家批评指教，本书专属邮箱：jiang.visualize.ml@gmail.com

比 0.87 更大的相关性系数是 0.96，这个相关性系数是花瓣长度、宽度之间的关系，而非花萼、花瓣之间的关系。

此外，CCA 分析中，图 7 的相关性系数矩阵就相当于图 3 的协方差矩阵。

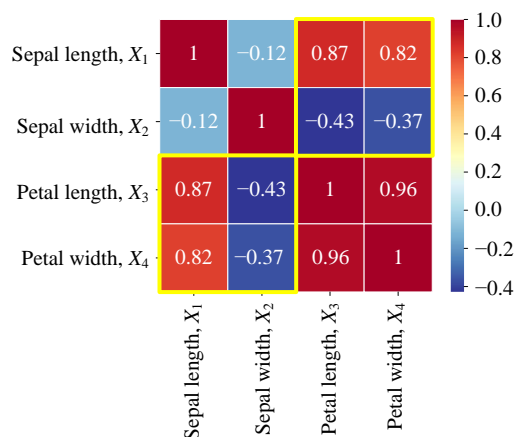


图 7. 鸢尾花数据的相关性系数矩阵

CCA 结果

通过 CCA 分析，我们得到的结果如图 8 (a) 所示。大家可以在本章代码中自行验算，可以发现图 8 (a) 中每一列均值均为 0。

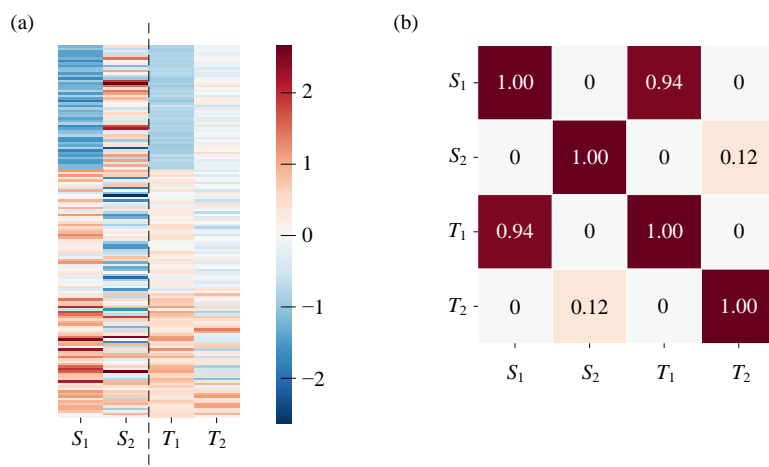


图 8. CCA 分析结果

图 8 (b) 所示为图 8 (a) 结果的相关性系数矩阵。 S_1 和 T_1 的相关性系数达到 0.94。此外，大家发现图 8 (b) 中很多相关性系数为 0 的情况，这就是本章前文介绍的优化问题约束条件。

图 9 所示为用散点图可视化 S_1 和 T_1 的关系。图 9 (b) 还考虑了鸢尾花分类。观察图 9 (a)，大家可能已经发现 S_1 和 T_1 均方差明显不同。

图 10 所示为 CCA 结果成对特征散点图。

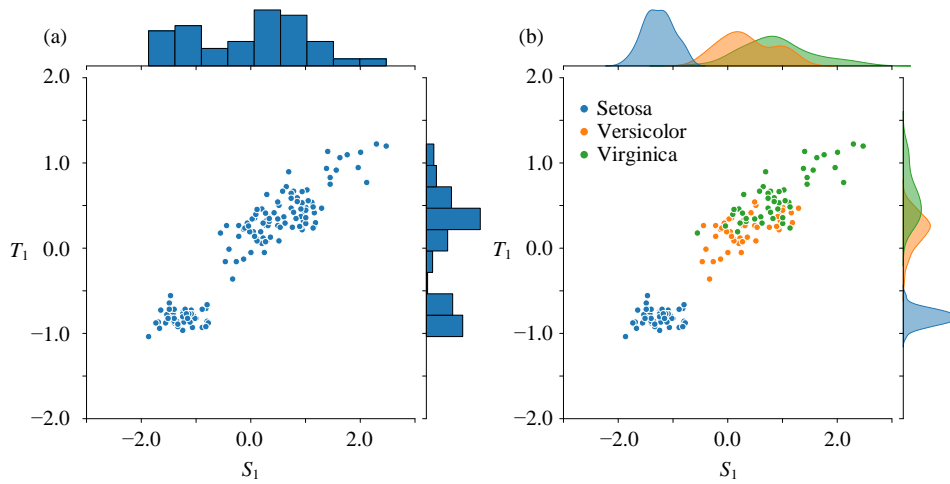
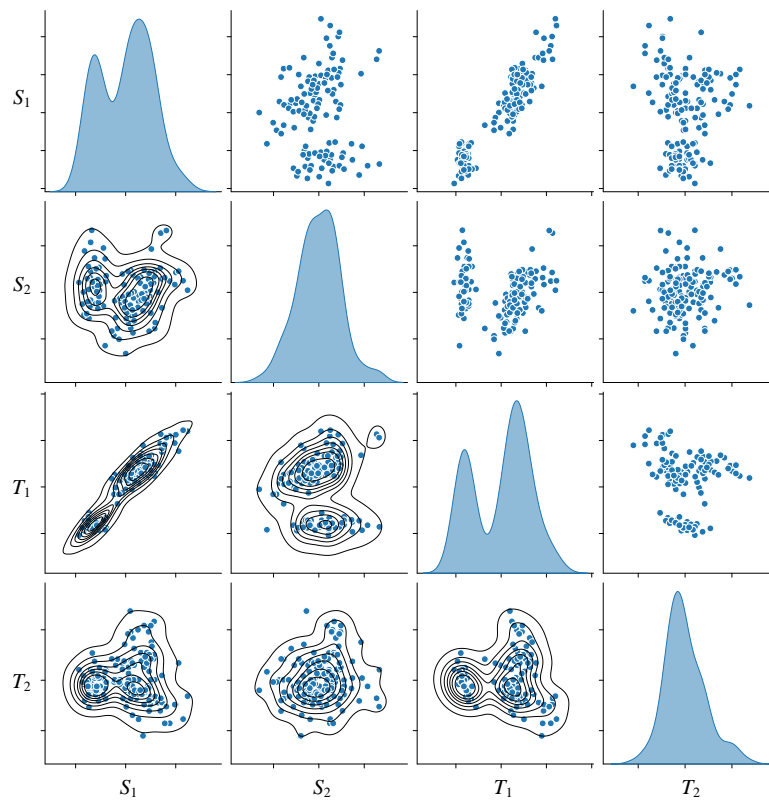
图 9. S_1 和 T_1 的散点图

图 10. CCA 结果成对特征散点图

投影

大家可能会好奇到底怎样的 \mathbf{u}_1 、 \mathbf{v}_1 让 S_1 和 T_1 的相关性系数如此之大？

`sklearn.cross_decomposition.CCA()` 函数同样返回 \mathbf{u}_1 、 \mathbf{v}_1 ，具体如图 11 所示。

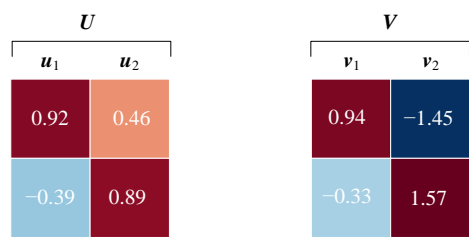


图 11. CCA 投影向量结果

假设 $\mathbf{X} = [\mathbf{x}_1, \mathbf{x}_2]$ 已经标准化, \mathbf{x}_1 和 \mathbf{x}_2 按如下方式线性组合得到 \mathbf{s}_1 :

$$\mathbf{s}_1 = \mathbf{X}_{150 \times 2} \mathbf{u}_1 = \begin{bmatrix} \mathbf{x}_1 & \mathbf{x}_2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 0.92 \\ -0.39 \end{bmatrix} = 0.92\mathbf{x}_1 - 0.39\mathbf{x}_2 \tag{18}$$

大家可以自己验证 \mathbf{u}_1 为单位向量。

同样, 假设 $\mathbf{Y} = [\mathbf{y}_1, \mathbf{y}_2]$ 已经标准化, \mathbf{y}_1 和 \mathbf{y}_2 按如下方式线性组合得到 \mathbf{t}_1 :

$$\mathbf{t}_1 = \mathbf{Y}_{150 \times 2} \mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} \mathbf{y}_1 & \mathbf{y}_2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 0.94 \\ -0.33 \end{bmatrix} = 0.94\mathbf{x}_1 - 0.33\mathbf{x}_2 \tag{19}$$

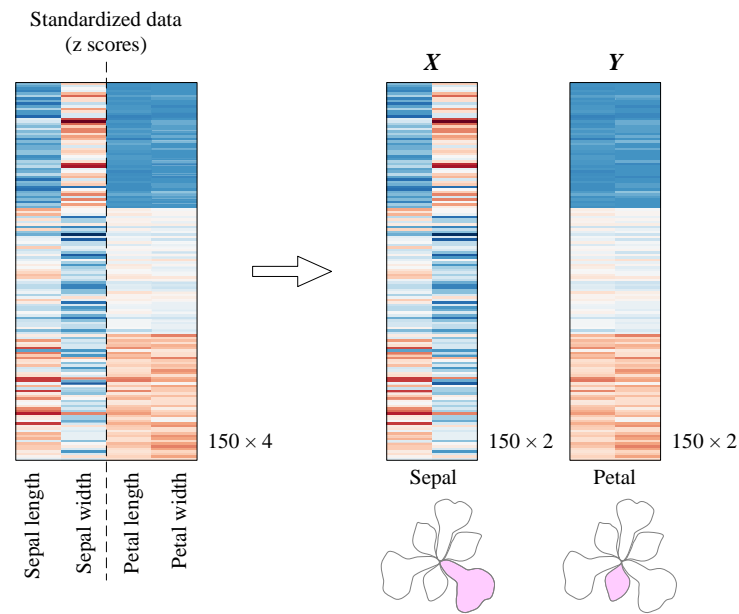
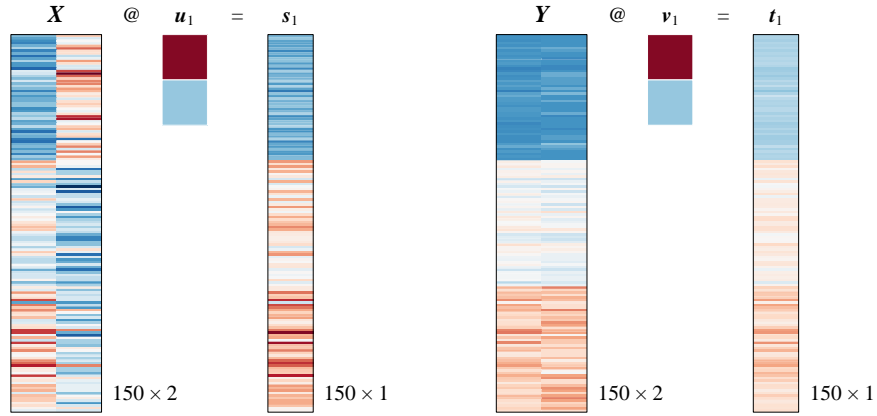
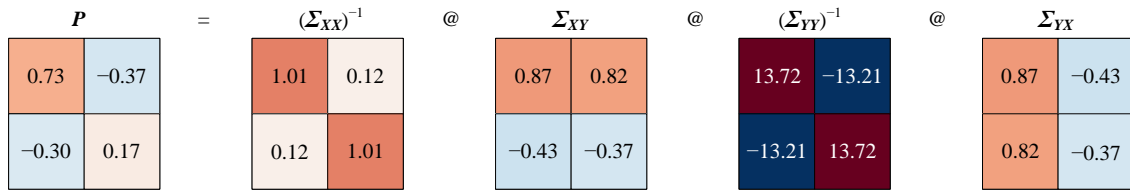
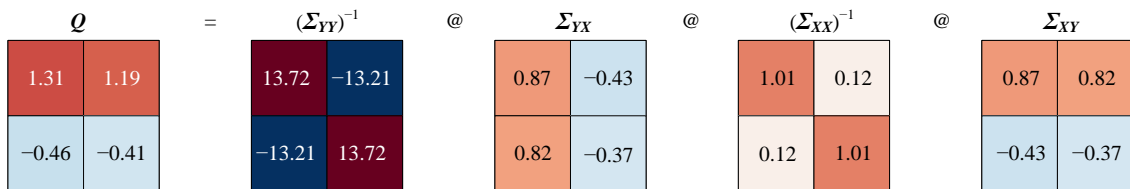


图 12. 标准化的鸢尾花数据


图 13. 通过投影计算 s_1 和 t_1

特征值分解

下面我们利用特征值分解自行求解 u_1 、 v_1 。根据图 4 和图 5，我们先需要计算 P 和 Q 两个方阵。具体过程如图 14、图 15 所示。


图 14. 计算矩阵 P

图 15. 计算矩阵 Q

然后对 P 和 Q 分别进行特征值分解，具体如图 16、图 17 所示。

注意，图 17 中矩阵 V 的第 2 列向量 v_2 和图 11 中不同，但是两者为倍数关系，即共线。

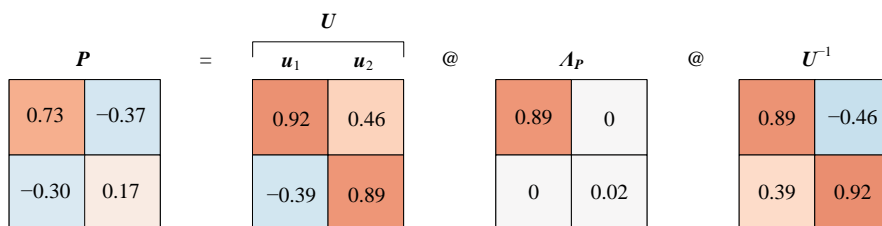


图 16. 矩阵 P 特征值分解

$$Q = \begin{bmatrix} v_1 & v_2 \end{bmatrix} @ \Lambda_Q @ V^{-1}$$

Q	$=$	$\begin{bmatrix} v_1 & v_2 \end{bmatrix}$	$@$	Λ_Q	$@$	V^{-1}																
<table><tr><td>1.31</td><td>1.19</td></tr><tr><td>-0.46</td><td>-0.41</td></tr></table>	1.31	1.19	-0.46	-0.41		<table><tr><td>0.94</td><td>-0.68</td></tr><tr><td>-0.33</td><td>0.73</td></tr></table>	0.94	-0.68	-0.33	0.73		<table><tr><td>0.89</td><td>0</td></tr><tr><td>0</td><td>0.02</td></tr></table>	0.89	0	0	0.02		<table><tr><td>1.57</td><td>1.45</td></tr><tr><td>0.71</td><td>2.02</td></tr></table>	1.57	1.45	0.71	2.02
1.31	1.19																					
-0.46	-0.41																					
0.94	-0.68																					
-0.33	0.73																					
0.89	0																					
0	0.02																					
1.57	1.45																					
0.71	2.02																					

图 17. 矩阵 Q 特征值分解



Bk7_Ch19_01.ipynb 完成本章 CCA 分析及可视化。



至此，我们完成了本书所有有关“降维”算法的学习。请大家务必掌握六种不同主成分的异同，以及经济型 SVD 分解、截断型 SVD 分解。另外，大家需要了解 PCA 算法的局限性。对于非线性数据降维，大家可以试着用核 PCA；核 PCA 将非线性数据投影到高维度空间，再投影。