МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ

УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ

«МОСКОВСКИЙ АВИАЦИОННЫЙ ИНСТИТУТ

(национальный исследовательский университет)»

ОТЧЕТ ПО КУРСОВОЙ РАБОТЕ

по дисциплине «Статистические методы обработки данных»

Тема: «Методы кодирования категориальных признаков в задаче бинарной классификации»

Выполнил cтудент группы М80-101М-21

         Фейзуллин К.М.

Руководитель: канд. физ.-мат. наук, доцент кафедры 804 Платонов Е.Н.

Оглавление

[**Введение** 4](#_Toc90225731)

[**Постановка задачи** 5](#_Toc90225732)

[**Описание эксперимента** 6](#_Toc90225733)

[**Функционал качества** 6](#_Toc90225734)

[**Описание исходных данных** 9](#_Toc90225735)

[**Базовая модель** 11](#_Toc90225736)

[**Экспериментальная установка** 12](#_Toc90225737)

# **Введение**

Целью работы является исследование влияния методов кодирования категориальных признаков в задаче бинарной классификации на функционал качества работы прогнозирующей математической модели.

В эру больших данных и расцвета автоматизированных алгоритмов обработки информации и прогнозирования важную роль занимают сами методы обработки. Помимо целочисленных и вещественных признаков нередко приходиться сталкиваться и с категориальными данными, которые требуют особый подход для дальнейшей работы с ними.

Актуальность данного исследования состоит в том, что до сих пор точно неизвестно, для какого рода задач и для каких сущностей переменных то или иное кодирование покажет наилучший результат.

Причем, данная задача бинарной классификации нередко используется для решения разного типа проблем, будь то прогноз подорожания или роста акции, решение о предоставления кредита или ипотеки, определение вредоносности программного обеспечения по показателям системы. Как можно понять, данная задача имеет множество приложений и в том числе выгодных с экономической точки зрения.

Но очень важно учитывать, что качество работы математической модели имеет зависимость с качеством данных, которые обрабатываются алгоритмом прогноза.

Поэтому нахождение оптимальных методов кодирования напрямую скажется на качестве работы прогнозирующей модели.

# **Постановка задачи**

Целью задачи является исследование методов кодирования категориальных признаков в задаче бинарной классификации. Функционалом качества работы алгоритма бинарной классификации является метрика ROC AUC (Receiver Operating Characteristic Area Under Curve), которая представляет из себя интегральную сумму от пороговой функции отношения доли верно определенных положительных меток и доли ложно определенных положительно меток.

Необходимо используя различные способы кодирования категориальных признаков и через создание новых признаков добиться оптимального результата.

Все варианты кодирования (различные наборы признаков) и соответствующую точность решения задачи будут занесены в сводную таблицу.

# **Описание эксперимента**

## **Функционал качества**

Как уже было сказано выше, положительное влияние тех или иных методов кодирования будет определяться с помощью функционала качества ROC AUC. Чтобы определить ее введем карту обозначений, приведенную в таблице 1.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | | Прогноз | |
| 1 | 0 |
| Правильный ответ | 1 | TP (True – positives) | FN (False – negatives) |
| 0 | FP (False – positives) | TN (True – negatives) |

Табл.1 – карта обозначений.

Определим обозначения, в нашем случае, как TP (True – positives) – число раз, когда объект положительно определен верно, FP (False – positives) – когда объект положительно определен ложно, FN (False – negatives) – когда объект отрицательно определен ложно и TN (True – negatives) – когда объект отрицательно определен верно.

Из этих характеристик определяются TPR (True positive rate) и FPR (False positive rate), доля истинно положительных ответов и доля ложно положительных ответов соответственно:

Далее вносит свой вклад природа бинарного классификатора. Простейший линейный классификатор имеет вид:

),

Где X – входной сигнал, Y – выходной сигнал, – некая пороговая функций, – масштабирующий коэффициент, а – пороговое значение классификатора.

Последовательно варьируя пороговое значение и находя в каждом значении значение TPR и FPR будет определена пороговая функция ROC вида, как на рисунке 1:

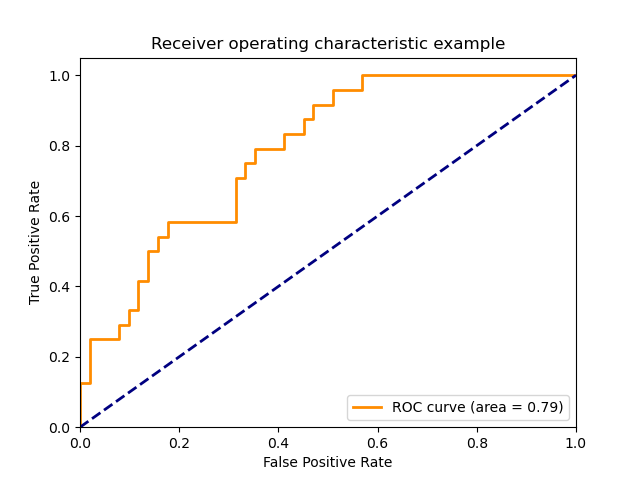


Рисунок . График пороговой функции ROC

Как видно, данная функция будет стремиться к левому верхнему углу и ROC AUC (площадь под данной кривой) будет стремиться к единице. То есть, чем больше площадь под кривой AUC, тем больше свободы в выборе порогового значения для наилучшей работы алгоритма классификации, ведь нам желательно максимизировать TPR и минимизировать FPR.

Предельный вид кривой ROC на рисунке 2:

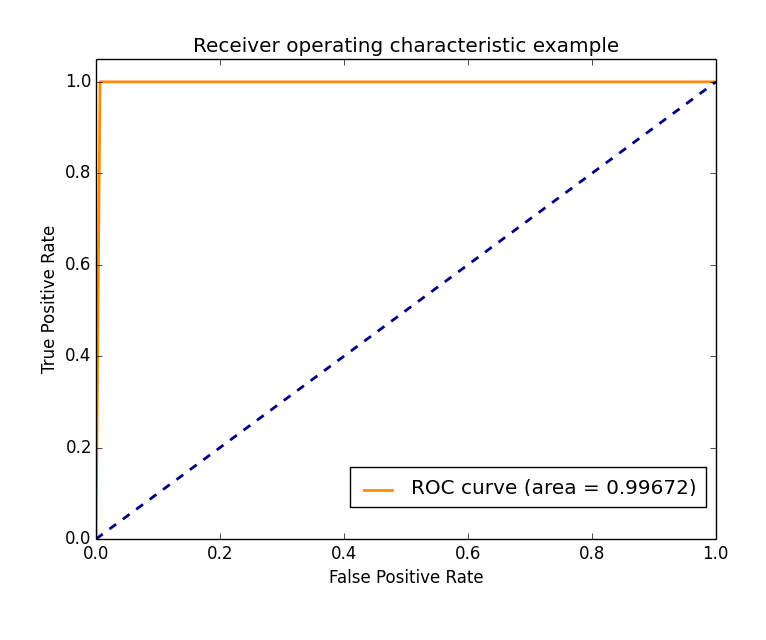


Рисунок . Предельный вид пороговой функции ROC

В случае классификатора, имеющий функцию ROC как на рисунке 2, можно выбрать порог классификатора так, чтобы TPR был равен единице, что значит все положительные метки определены верно, а показатель FPR стремится к нулю, что практически значит отсутствие ложно положительных прогнозов.

## **Описание исходных данных**

Для исследования были взяты анонимизированые признаки. Набор данных содержит только категориальные функции и включает:

* бинарные признаки
* номинальные признаки с низкой и высокой частотой категорий
* порядковые признаки с низкой и высокой частотой категорий
* (потенциально) циклические признаки

Исходные данные составляют не только численные данные, но и строковые. Пример исходных данных на рисунке 3.

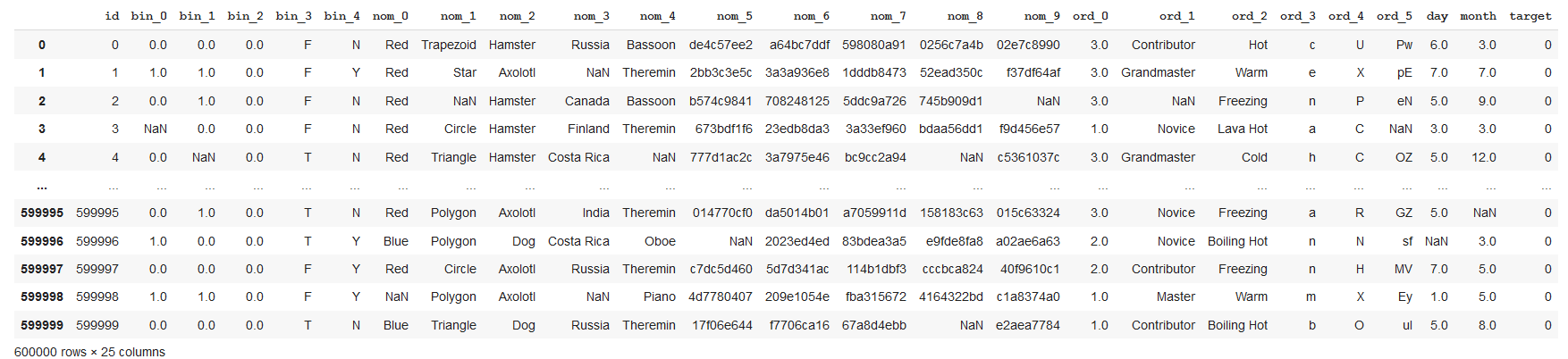


Рисунок . Исходные данные

Помимо признаковых переменных данные содержат и ответ (target). В каждой строке определенны значения переменной и соответствующий им ответ.

Стоит добавить, что каждая переменная имеет потери данных 3-4% и при исключении всех строк с потерями, количество данных сокращается вдвое.

Так же важным фактором является то, что присутствует сильное преобладание отрицательных ответов над положительными, диспропорция составлять 5:1. Но так как в данной работе функционалом качества определена площадь под кривой AUC, которая не чувствительна к такому роду проблем, никаких действий можно не предпринимать.

Если слепо факторизовать каждую переменную и построить корреляционную матрицу, то получим следующее на рисунке 4.

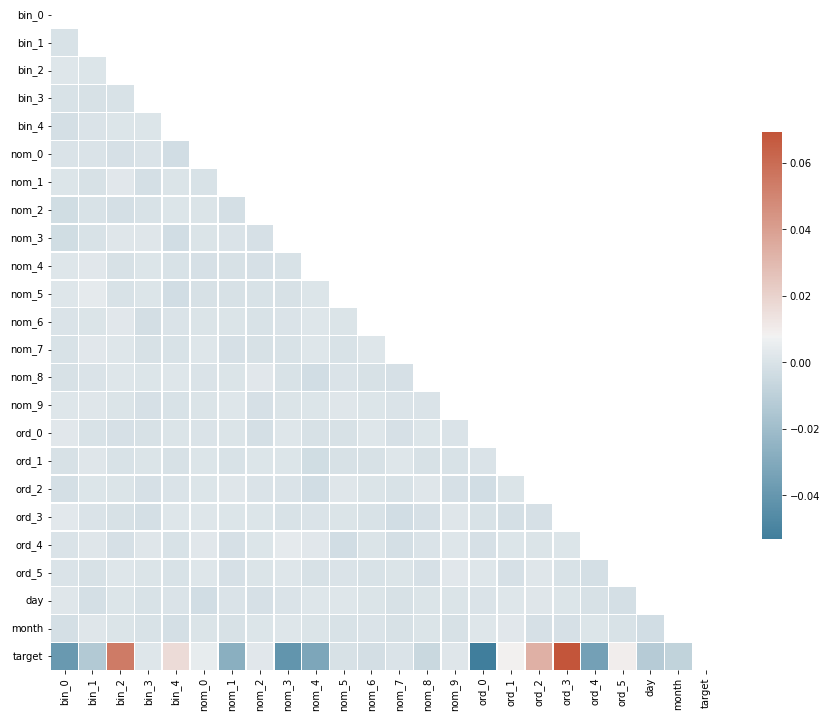


Рисунок . Корреляционная треугольная матрица.

Как видно, некоторые переменные выделяются на фоне остальных (bin\_2, ord\_0, ord\_3), имея наибольшие значения корреляции с target переменной, но данная сила стохастической связи все еще очень мала.

## **Базовая модель**

Перед проведением экспериментов следует определить базовую модель, от функционала качества которой нужно будет отталкиваться. Так как в нашем случае задача бинарной классификации, базовую модель можно определить как бросок монетки.

С помощью генератора случайных чисел, распределенных по равномерному закону распределения от 0 до 1, получено базовое решение с функционалом качества ROC AUC = 0.5.

## **Экспериментальная установка**

Исследование методов категорийного кодирования реализовано на высокоуровневом языке программирования Python, с использованием библиотек scikit-learn, keras, tensorflow для кодирования признаков и реализации алгоритма бинарной классификации. Запуск программы совершен на бесплатной облачной платформе Google Colab, которая позволяет совершать неподъемные для домашней машины вычисления.

В случае использования нейронной сети для бинарной классификации, она будет состоять из 5 скрытых слоев с функцией активации ReLu, с 512 нейронов прямого распространения на каждом слое и 2 нейрона на выходном слое с сигмоидной функцией активации SoftMax. Обучение модели будет проходить на протяжении 50 эпох с объемом пакета одновременной обработки в 8192 строки.

Также в исследования участвует алгоритм логистической регрессии с параметрами по умолчанию.

## **Методы кодирования**

В данной работе рассмотрены наиболее частые и стандартные методы категорийного кодирования:

* Факторизация (кодирование метки);
* Горячее кодирование (One Hot Encoding);
* Хэширование.

Далее рассмотрим каждый метод подробнее.

Факторизация – каждому значению переменной будет присвоен свой порядковый номер. Данный метод наиболее распространен для перехода от строковых значений к численным, для дальнейшей обработки алгоритмом классификации. В данном методе пропускам в данных будет отведена отдельная категория.

Горячее кодирование – каждая переменная преобразуется в признаковый вектор размерности, равной количеству уникальных признаков. Тогда каждое значение будет кодироваться как вектор, состоящей из единицы в соответствующему значению столбце и нулей.

Хэширование – данный метод преобразует категориальные переменные в пространство целых чисел высших измерений, где расстояние между двумя векторами категориальных переменных приблизительно поддерживается в преобразованном числовом пространстве. При использовании хеширования число измерений будет намного меньше количества измерений с кодировкой, например One Hot Encoding. Однако данный метод позволяет и расширить пространство признаков.

Помимо методов кодирования также были разобраны методы обработки признаков:

* Отбор признаков;
* Слияние признаков;
* Скрещивание признаков;
* Восстановление семантической значимости.

Также рассмотрим каждый подробнее.

Отбор признаков – для обучения алгоритма классификации отбираются наиболее коррелированные признаки.

Слияние признаков – сведение пары признаков в один класс. В данной работе будет использован достаточно радикальный метод слияния – кластеризация по всем признакам.

Скрещивание признаков – отличие от прошлого метода в том, что один признак может быть скрещен со многими другими одновременно. Данный метод будет реализован с помощью нейронной сети, реализующая множество скрещиваний благодаря своей природе.

Восстановление семантической значимости – слепое кодирование категориальных строковых признаков не всегда позволит достичь наивысшего показателя функционала качества. Если количество уникальных значений категориального признака не велико, то можно постараться закодировать его самостоятельно. Это поможет с такими признаками, градация уровней мастерства, градация температуры: холодно, тепло, горячо; Иначе говоря, при кодирование сохраняется порядок значений.