

# 课后练习1

-

## 1 问题一

### 1.1

$$\text{令 } x = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 2 & 2 & 1 \\ 3 & 4 & 1 \end{bmatrix}, y = \begin{bmatrix} 1 \\ 3 \\ 4 \end{bmatrix}, \hat{w} = \begin{bmatrix} w_1 \\ w_2 \\ b \end{bmatrix}, \text{可以计算 } x^T x = \begin{bmatrix} 13 & 16 & 5 \\ 16 & 21 & 7 \\ 5 & 7 & 3 \end{bmatrix}$$

$$\text{那么 } \hat{w} = (x^T x)^{-1} x^T y = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \\ 1 \end{bmatrix}, \text{故 } w_1 = 1, w_2 = 0, b = 1$$

### 1.2

$$\text{此时 } x = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 2 & 1 \\ 2 & 2 & 4 & 1 \\ 3 & 4 & 8 & 1 \end{bmatrix}, \hat{w} = \begin{bmatrix} w_1 \\ w_2 \\ w_3 \\ b \end{bmatrix}, \text{计算 } x^T x = \begin{bmatrix} 13 & 16 & 32 & 5 \\ 16 & 21 & 42 & 7 \\ 32 & 42 & 84 & 14 \\ 5 & 7 & 14 & 3 \end{bmatrix}, \text{可以发现这是一}$$

个奇异矩阵(有重复的行), 没有逆矩阵, 因此此时线性回归没有唯一解

### 1.3

$$\text{已知 } \lambda = 1, \text{故 } x^T x + \lambda I = \begin{bmatrix} 14 & 16 & 32 & 5 \\ 16 & 22 & 42 & 7 \\ 32 & 42 & 85 & 14 \\ 5 & 7 & 14 & 4 \end{bmatrix}$$

$$\text{那么 } \hat{w} = (x^T x + \lambda I)^{-1} x^T y = \begin{bmatrix} 0.378 \\ 0.140 \\ 0.280 \\ 0.304 \end{bmatrix}, \text{因此可得 } w_1 = 0.378, w_2 = 0.140, w_3 =$$

0.280,  $b = 0.304$

## 2 问题二

### 2.1

令  $X = \begin{bmatrix} x_1^T, 1 \\ \vdots \\ x_n^T, 1 \end{bmatrix}$ ,  $R = \begin{bmatrix} r_1 & & \\ & \ddots & \\ & & r_n \end{bmatrix}$ , 则我们可以将损失函数写成矩阵的形式:

$$L(\hat{w}) = (y - X\hat{w})^T R (y - X\hat{w}) + \lambda \hat{w}^T \hat{w}$$

计算偏导数:

$$\begin{aligned} \frac{\partial L(\hat{w})}{\partial \hat{w}} &= \frac{\partial (y^T R y - y^T R X \hat{w} - \hat{w}^T X^T R y + \hat{w}^T X^T R X \hat{w} + \lambda \hat{w}^T \hat{w})}{\partial \hat{w}} \\ &= \frac{\partial (y^T R y - 2y^T R X \hat{w} + \hat{w}^T X^T R X \hat{w} + \lambda \hat{w}^T \hat{w})}{\partial \hat{w}} \\ &= -2X^T R y + 2X^T R X \hat{w} + 2\lambda I \hat{w} \\ &= 0 \end{aligned}$$

解得:

$$\hat{w} = (X^T R X + \lambda I)^{-1} X^T R y$$

### 2.2

通过人为加入权重可以对不同的数据的重要性进行评估和加权, 能够更准确地进行评估和预测, 这样更重要的数据权重更大, 能更好地反映实际情况

加权计算和直接将  $(x_i, y_i)$  复制  $r_i$  次的结果是一样的

不妨设复制数据后的矩阵为  $\bar{X}$  和  $\bar{y}$ , 则我们可以发现  $X^T R X = \bar{X}^T \bar{X}$  (其中  $\odot$  表示元素与元素相乘):

$$\begin{aligned} \begin{bmatrix} x_1 & \dots & x_n \\ 1 & \dots & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} r_1 & & \\ & \ddots & \\ & & r_n \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1^T, 1 \\ \vdots \\ x_n^T, 1 \end{bmatrix} &= \begin{bmatrix} r_1 \odot x_1 & \dots & r_n \odot x_n \\ r_1 & \dots & r_n \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1^T, 1 \\ \vdots \\ x_n^T, 1 \end{bmatrix} \\ &= \begin{bmatrix} x_{1,1} & \dots & x_{1,r_1} & \dots & x_{n,1} & \dots & x_{n,r_n} \\ 1 & \dots & 1 & \dots & 1 & \dots & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_{1,1}^T, 1 \\ \dots \\ x_{1,r_1}^T, 1 \\ \dots \\ x_{n,1}^T, 1 \\ \dots \\ x_{n,r_n}^T, 1 \end{bmatrix} \end{aligned}$$

同理地有  $X^T R y = \bar{X}^T \bar{y}$ , 因此这两种计算方式都是可行的

## 3 问题三

### 3.1

$$\text{Cross-Entropy Loss} = - \sum_{i=1}^n t_i \log[\sigma(w^T x_i + b)]$$

### 3.2

对于 $x_i$ 来说, 它的似然函数是 $L_i(\theta) = \sigma(z)^{t_i}$ , 其中 $t_i$ 是一个0到1之间的实数, 表示 $y_i = 1$ 的概率, 我们依然希望这个似然函数尽量大, 使得模型能够更好地预测 $y_i$ , 因此我们要取log再取负, 得到我们可以优化的损失函数

## 4 问题四

### 4.1

**Proof** 假设对于任意一个超平面 $w^T x + b = 0$ , 存在最大的 $k$ 使得 $f(x) = (kw)^T x + kb$ 是一个最大似然解, 那么对于损失函数 $L_k = - \sum_{i=1}^n (y_i \log(\sigma(z)) + (1 - y_i)(1 - \log(\sigma(z))))$ , 其中 $z = (kw)^T x + kb$ , 一定有 $|\sigma((kw)^T x + kb)| < |\sigma(((k+1)w)^T x + (k+1)b)|$ , 此时显然有 $L_{k+1} < L_k$ , 这说明 $k+1$ 相比 $k$ 是一个更好地选择, 说明假设不成立, 不存在一个最大的 $k$ 使得损失函数达到最小值, 因此有 $k \rightarrow \infty$ 时,  $\|kw\| \rightarrow \infty$ ,  $f(x)$ 都是一个最大似然解

### 4.2

L2正则化相当于对参数施加了一个惩罚, 使得参数不能过分地大, 否则就会导致损失函数变大. 模型相当于会学习一个交叉熵和正则化之间的“平衡值”, 这个值一定是有限且唯一的, 因为交叉熵希望参数尽可能大, 而正则化希望参数都为0, 二者共同作用之下, 就能确定一个唯一的解