

Day 33

機器學習

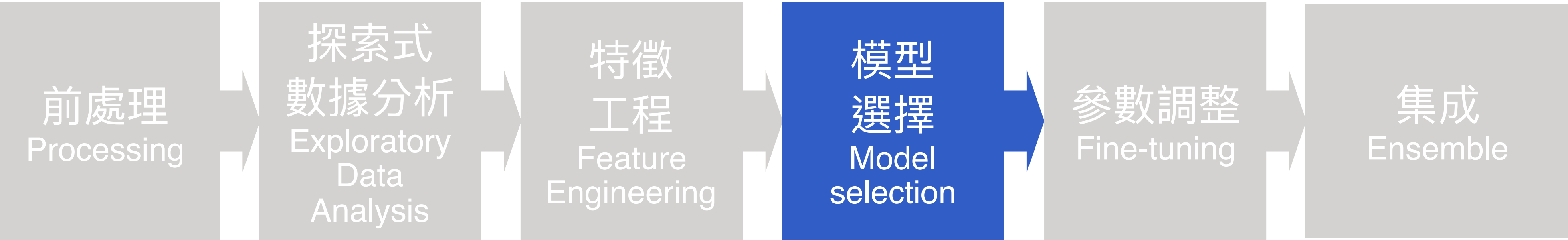
機器如何學習？



知識地圖 機器學習- 模型選擇 - 機器如何學習？

機器學習概論 Introduction of Machine Learning

監督式學習 Supervised Learning



非監督式學習 Unsupervised Learning



模型選擇 Model selection

概論

- 驗證基礎
- 預測類型
- 評估指標

基礎模型 Basic Model

- 線性回歸 Linear Regression
- 邏輯斯回歸 Logistic Regression
- 套索算法 LASSO
- 嶺回歸 Ridge Regression

樹狀模型 Tree based Model

- 決策樹 Decision Tree
- 隨機森林 Random Forest
- 梯度提升機 Gradient Boosting Machine

本日知識點目標

- 了解機器學習的原理
- 機器學習的模型是如何訓練出來的
- 過擬合 (Overfitting) 是甚麼，該如何解決

機器如何學習？

有三個步驟

1

定義好模型 (可以是線性回歸、決策樹、神經網路等等)

2

評估模型的好壞

3

找出讓訓練目標最佳的模型參數

機器如何學習 - 定義模型 (1/3)

- 一個機器學習模型中會有許多參數 (parameters)，例如線性回歸中的 w (weights) 跟 b (bias) 就是線性回歸模型的參數
- 當我們輸入一個 x 進到模型中，不同參數的模型就會產生不同的 \hat{y}
 - 希望模型產生的 \hat{y} 跟真實答案的 y 越接近越好
 - 找出一組參數，讓模型產生的 \hat{y} 與真正的 y 很接近，這個步驟就有點像學習的概念

Step 1: Model

$$y = b + w \cdot x_{cp}$$



w and b are parameters
(can be any value)

• $f_1: y = 10.0 + 9.0 \cdot x_{cp}$

$f_2: y = 9.8 + 9.2 \cdot x_{cp}$

$f_3: y = -0.8 - 1.2 \cdot x_{cp}$

..... infinite

圖片來源：[李宏毅ML Lecture 1: Regression - Case Study](#)

機器如何學習 - 評估模型的好壞 (2/3)

- 定義一個目標函數 (Objective function) 也可稱作損失函數 (Loss function)，來衡量模型的好壞
- 線性回歸模型我們可以使用均方差 (mean square error) 來衡量

$$\text{MSE} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2$$

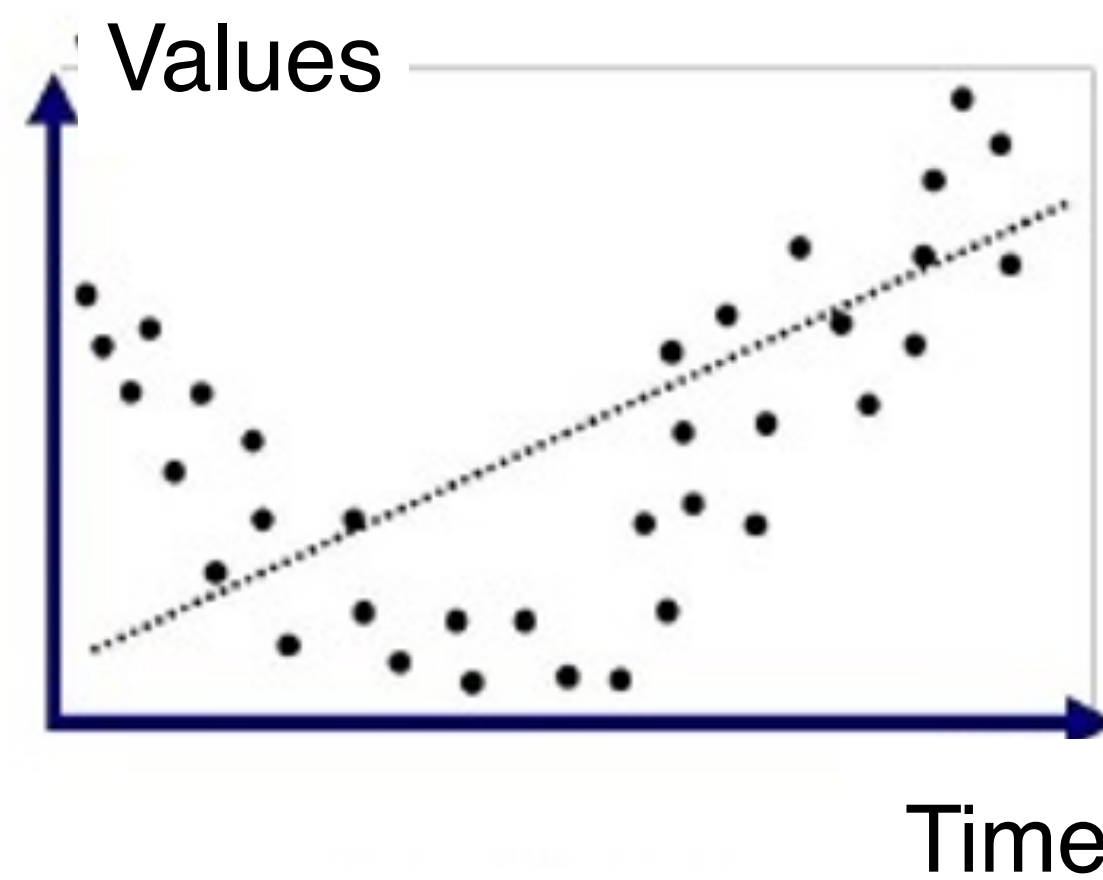
- Loss 越大，代表這組參數的模型預測出的 \hat{y} 越不準，也代表不應該選這組參數的模型

機器如何學習 - 找出最好的模型參數 (3/3)

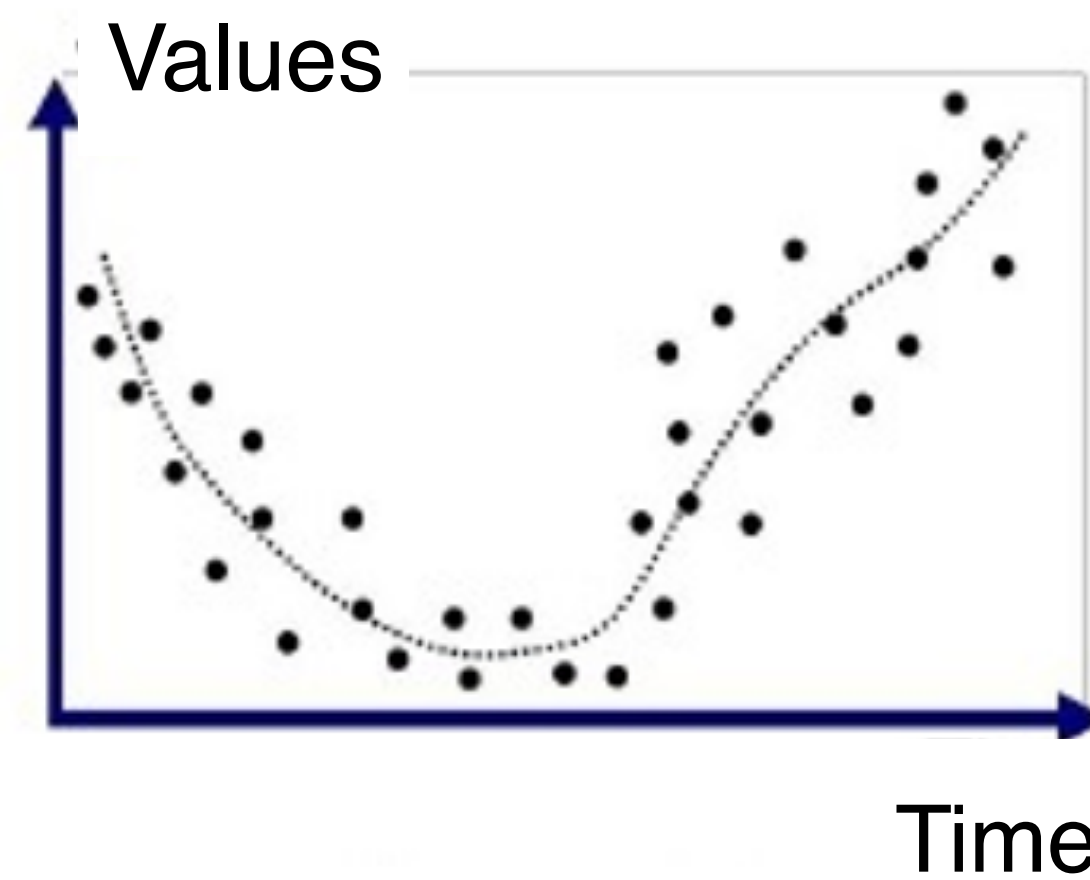
- 模型的參數組合可能有無限多組，我們可以用暴力法每個參數都試看看，從中找到讓損失函數最小的參數
- 但是這樣非常沒有效率，有許多像是梯度下降 (Gradient Descent)、增量訓練 (Additive Training) 等方式，這些演算法可以幫我們找到可能的最佳模型參數

過擬合 (Over-fitting)

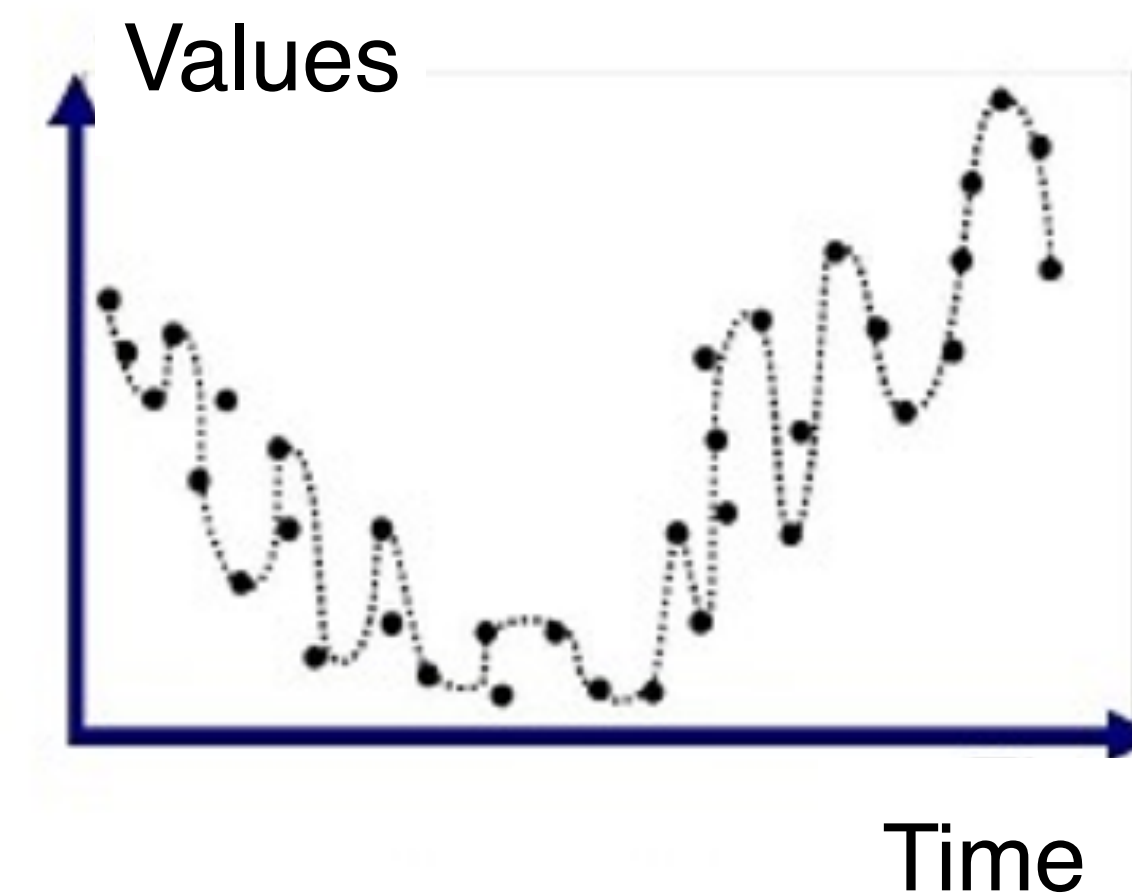
- 模型的訓練目標是將損失函數的損失降至最低
- 過擬合代表模型可能學習到資料中的噪音，導致在實際應用時預測失準



Underfitted



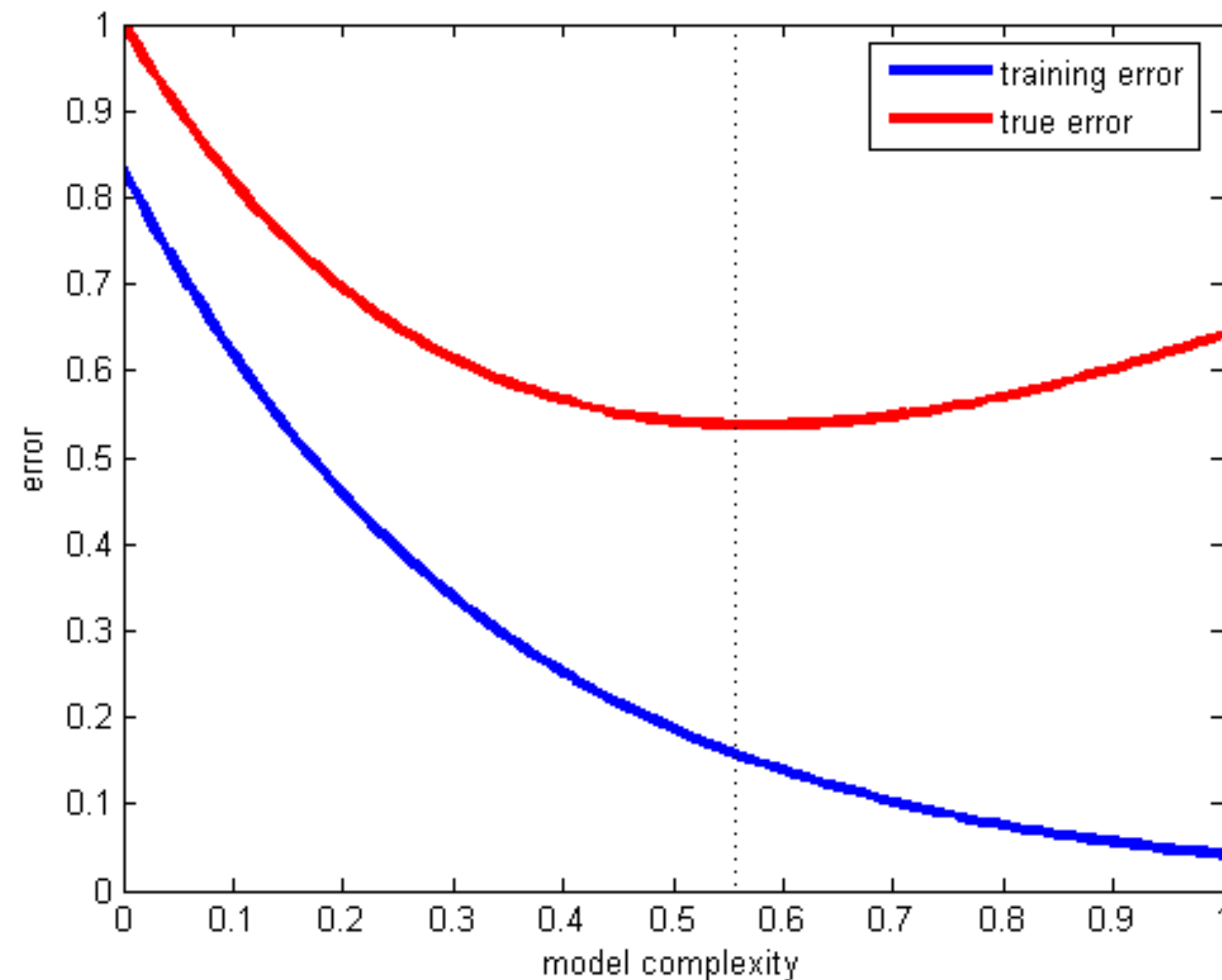
Good Fit/Robust



Overfitted

學習曲線 Learning curve

- 如何知道模型已經過擬合了？
- 保留一些測試資料，觀察模型對於訓練資料的誤差與測試資料的誤差，是否有改變的趨勢



圖片來源：[CIS 520 Machine learning](#)

如何解決過擬合或欠擬合

- 過擬合
 - 增加資料量
 - 降低模型複雜度
 - 使用正規化 (Regularization)
- 欠擬合
 - 增加模型複雜度
 - 減輕或不使用正規化

常見問題



Q：前三天的課程作業好像都沒有程式碼？

A：機器學習的概念非常重要，我們希望學員先對機器學習有基本且正確的認識，後續再開始實作程式碼，避免因為撰寫程式碼卡關而對機器學習概念沒有正確的認知。

常見問題



Q：過擬合在實務上經常發生嗎？跟所選的模型有關？

A：當資料沒有很大量時，過擬合實務上非常容易發生，正確了解是否有過擬合以及如何解決是非常重要的。所選模型也跟是否容易過擬合有關，像是後面課程會學到的決策樹模型就是個非常容易過擬合的模型，必須透過適當的正規化來緩解過擬合的情形。

解題時間 It's Your Turn

請跳出PDF至官網Sample Code & 作業
開始解題

