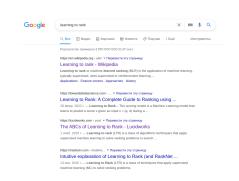
# Ранжирование (Learning to Rank)

### Виктор Китов

v.v.kitov@yandex.ru

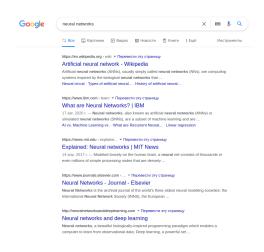


## Содержание

- Постановка задачи
- 2 Формирование вектора признаков
- Поточечные (pointwise) методы
- 4 Попарные (pairwise) методы
- 5 Списочные (listwise) методы
- Меры качества ранжирования

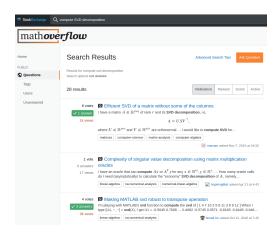
### Примеры ранжирования

#### Ранжирование веб-страниц по запросу:



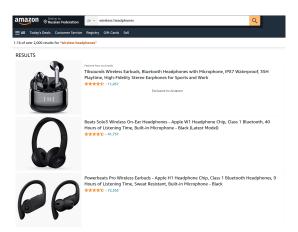
### Примеры ранжирования

#### Ранжирование ответов на вопрос:



### Примеры ранжирования

#### Ранжирование товаров по запросу:



### Постановка задачи

- и пользователь
- q поисковый запрос
- d ранжируемая сущность (например документ поисковой выдачи)
  - др. примеры: веб-страницы, ответы на вопрос, товары, ...
- Изучаемый объект тройка:

$$x = (u, d, q)$$

- Задача: построить f(x), выдающий
  - большое значение для релевантных объектов
  - малое значение для нерелевантных

## Содержание

- Постановка задачи
- 2 Формирование вектора признаков
- Поточечные (pointwise) методы
- 4 Попарные (pairwise) методы
- 5 Списочные (listwise) методы
- Меры качества ранжирования

• Формирование вектора признаков:

$$(u,q,d) \rightarrow (f_1(u), f_2(q), f_3(d), f_4(q,d))$$

Более сложный случай: рассмотреть взаимодействие пользователя с запросом и документом.

- Примеры пользовательских признаков:
  - пол. возраст
  - интересы, предыдущий запрос
  - вариативность кликов
  - средняя глубина просмотра результатов

### • Примеры запросных признаков:

- длина, счетчики слов, doc2vec
- популярность запроса
- тема запроса (среди заданных или определяемых тематич. моделированием)
- тип запроса:
  - навигационный (введен веб-адрес),
  - однозначный (например "википедия")
  - товарный ("купить беспроводные наушники")
  - вопросный ("курс доллара")
  - информационный ("группа Cranberries")
  - ...

#### • Примеры документных признаков:

- время создания
- длина документа, заголовка, #изображений, #ссылок
- счетчики слов, doc2vec
- тема документа (среди заданных или определяемых тематич. моделированием)
- популярность документа (#кликов, #ссылок на него, PageRank)

## PageRank

- PageRank способ расчета рейтинга веб-страниц.
- Рассмотрим пользователя, который
  - ullet с p=arepsilon (параметр) переходит на случайный документ
  - ullet с p=1-arepsilon переходит по ссылке в текущем документе
- PageRank(d) вероятность оказаться в d после бесконечно долгого блуждания:

$$PR(d) = rac{arepsilon}{|D|} + (1 - arepsilon) \sum_{d' \in D_{in}(d)} rac{PR(d')}{|D_{out}(d')|}$$

- |D|=#документов
- ullet  $D_{in}(d)$ -документы, ссылающиеся на d
- ullet  $D_{out}(d')$ -документы, на которые ссылается d'
- Это система линейных уравнений, можем решить численными методами.

- Примеры признаков взаимодействия  $f_4(d,q)$  (самый информативный тип признаков)
  - число общих слов, общих фраз
  - ВМ-25 и др. вариации следующего признака:

$$f(q,d) = \sum_{w=1}^{W} IDF(w|q) \cdot TF(w|d)$$

- cos-sim(embedding(d), embedding(q))
  - embedding(d) можно заранее посчитать
  - embedding можно обучить, используя triplet или contrastive loss => сиамская сеть
  - быстрый и достаточно точный для первичного отсева нерелевантных документов

### Ранжирование в реальных системах

- Пользователь формирует запрос.
- **2** Грубый отбор кандидатов ( $\sim 10^3$ )
  - например, cos-sim(embedding(d), embedding(q))≥ threshold
- Ранжирование
- Коррекция результатов
  - обеспечение разнообразия результатов
  - фильтрация спама
- Выдача

### Сбор обучающей выборки

- Отклики  $x \to y$  можем собирать:
  - из пользовательских данных
    - пользователь ввел запрос и кликнул/не кликнул
    - усредняя, получим вероятность клика при запросе
    - важно учитывать время на веб-странице, был ли впоследствии возобновлен поиск
  - из ручной разметки ассессорами по шкале
    - релевантен / не релевантен
    - степень релевантности (более информативно)
- Ручная разметка более точная, т.к. пользователь
  - при клике видит лишь сниппет
  - может увлечься документом, хотя он нерелевантный
  - не учитываются релевантные документы в конце выдачи

## Содержание

- Постановка задачи
- 2 Формирование вектора признаков
- Поточечные (pointwise) методы
- 4 Попарные (pairwise) методы
- 5 Списочные (listwise) методы
- Меры качества ранжирования

## Поточечные (pointwise) методы

### Поточечные (pointwise) методы ранжирования:

- $y \in \{1,0\}$  (релевантен/не релевантен)
  - бинарная классификация
    - ullet упорядочиваем выдачу по p(y=+1|x)
  - регрессия на +1, 0.
- $y \in \mathbb{R}$  степень релевантности. Тогда методы:
  - многоклассовая классификация
    - не учитывается порядок классов (нерел. <> рел. << сильно рел.)</li>
  - регрессия
    - оценки релевантности субъективны и произвольны
    - пользователю важен лишь порядок  $x_1 \succ x_2 \succ x_3 \succ ...$
    - ullet т.е. чтобы  $f(x_1) > f(x_2) > f(x_3) > ...$ , сами значения f(x) не важны.

 Как по релевантностям предсказывать релевантности, учитывая упорядоченность классов?

- Как по релевантностям предсказывать релевантности, учитывая упорядоченность классов?
- Порядковая регрессия (ordinal regression) метод классификации для упорядоченных классов.
  - степень релевантности, оценка на экзамене, уровень удовлетворенности услугой, ...
  - $x \to z(x) \in \mathbb{R} \to y \in \{1,2,...K\}$ , используя разбиение шкалы z на интервалы

Предполагаем соответствие между вещественной z(x) и порядковой y(x), а также вид зависимости z(x):

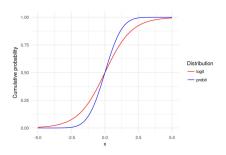
$$y = \begin{cases} 1 & z \leq \theta_1 \\ 2 & \theta_1 < z \leq \theta_2 \\ 3 & \theta_2 < z \leq \theta_3 \\ \cdots & \cdots \\ K & \theta_{K-1} < z \end{cases}$$

$$z=w^Tx+arepsilon,\quad arepsilon\sim F(\cdot)$$
 ф-ция распределения  $P(y=k|x)=P( heta_{k-1}< z\leq heta_k|x)=P( heta_{k-1}< w^Tx+arepsilon\leq heta_k) \ =F( heta_k-w^Tx)-F( heta_{k-1}-w^Tx) \ \prod_{w, heta}^N P(y_n|x_n) o \max_{w, heta}$  - находим веса и пороги

### Популярные $F(\cdot)$ :

$$F(u)=\sigma(u)=rac{1}{1+e^{-u}}$$
 - ordinal logit model  $F(u)=P(\eta\leq u),\ \eta\sim\mathcal{N}(0,1)$  - ordinal probit model

Logit и Probit функции распределения:



# Обобщение порядковой регрессии через ML<sup>1</sup>

- Обобщение:  $z = f_w(x)$ ,  $y = k \Longleftrightarrow \theta_{k-1} < f_w(x) \le \theta_k$ .
- Обучение по ближайшим порогам:

$$\sum_{n=1}^{N} \mathcal{L}\left(f_{w}(x_{n}) - \theta_{y_{n}-1}\right) + \mathcal{L}\left(\theta_{y_{n}} - f_{w}(x_{n})\right) \to \min_{w,\theta}$$

• Обучение по всем порогам:

$$\sum_{n=1}^{N} \sum_{k=1}^{K-1} \mathcal{L}\left(\left(\theta_{k} - f_{w}(x_{n})\right) \operatorname{sign}\left(k - y_{n}\right)\right) \to \min_{w,\theta}$$

$$sign(u) = \begin{cases} +1 & u \ge 0 \\ -1 & u < 0 \end{cases}$$

•  $\mathcal{L}(u) \downarrow$  как в классификации. Можно с регуляризацией.

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup>Loss functions for preference levels.

## Содержание

- Постановка задачи
- 2 Формирование вектора признаков
- Поточечные (pointwise) методы
- 4 Попарные (pairwise) методы
- 5 Списочные (listwise) методы
- Меры качества ранжирования

### Попарные (pairwise) методы

- Поточечные методы прогнозируют x o y.
  - неоднозначность назначения релевантностей
  - важен корректный порядок, а не точные прогнозы y  $x_i \succ x_j \succ ...$  может достигаться разными  $y_i \succ y_j \succ ...$
- Попарные (pairwise) методы решают напрямую задачу упорядочивания.

# Попарные (pairwise) методы

$$i \prec j \iff f_w(x_i) < f_w(x_j), \quad f_w(x) = w^T x \text{ (например)}$$
  $\sum_{i \prec j} \mathbb{I}\left[f_w(x_i) \geq f_w(x_j)\right] \leq \sum_{i \prec j} \mathcal{L}\left(f_w(x_j) - f_w(x_i)\right) \to \min_w$ 

Примеры  $\mathcal{L}(u)$ :

$$\mathcal{L}(u) = e^{-u}$$
 RankBoost  $\mathcal{L}(u) = \log_2 (1 + e^{-u})$  RankNet  $\mathcal{L}(u) = \max \{1 - u; 0\}$  RankSVM

### RankSVM<sup>2</sup>

$$\frac{1}{2} \|w\|_2^2 + C \sum_{i \prec j} \max \left\{ 1 - \left( f_w(x_j) - f_w(x_i) \right); 0 \right\} \to \min_{w}$$

соответствует задаче квадратичной оптимизации для  $f_w(x) = w^T x$ :

$$\begin{cases} \frac{1}{2} \|w\|_2^2 + C \sum_{i \prec j} \xi_{ij} \to \min_{w, \xi} \\ w^T (x_j - x_i) \ge 1 - \xi_{ij} & i \prec j \\ \xi_{ij} \ge 0 & i \prec j \end{cases}$$

и допускает ядерное обобщение (kernel trick).

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup>Ching-Pei Lee and Chih-Jen Lin. Large-scale Linear RankSVM

### RankNet

$$\sum_{i \prec i} \log_2 \left( 1 + e^{-\alpha \left( w^T x_j - w^T x_i \right)} \right) \to \min_w$$

Шаг SGD по случайной паре  $x_i \prec x_j$ :

$$w := w - \varepsilon \frac{e^{-\alpha(w^T x_j - w^T x_i)}}{1 + e^{-\alpha(w^T x_j - w^T x_i)}} (-\alpha) (x_j - x_i)$$
$$w := w + \varepsilon \alpha \frac{1}{1 + e^{+\alpha(w^T x_j - w^T x_i)}} (x_j - x_i)$$

Интуиция: чем сильнее  $w^T x_i > w^T x_j$ , тем сильнее сдвигаем w в сторону  $x_j$ , чтобы  $\uparrow w^T x_j$ .

# Содержание

- Постановка задачи
- 2 Формирование вектора признаков
- Поточечные (pointwise) методы
- 4 Попарные (pairwise) методы
- 5 Списочные (listwise) методы
- Меры качества ранжирования

# Списочные (listwise) методы

- Списочные (listwise) методы пытаются оптимизировать весь список документов целиком.
  - самые точные, т.к. оптимизируют всю выдачу документов.
- Проблема: метрики качества зависят от порядка, который дискретен и недифференцируем.
- Подходы списочных методов:
  - ullet взвешивать пары (i,j) согласно списочной мере качества
    - LambdaRank, LambdaMART
  - оптимизация сглаженной меры качества списка
    - SoftRank оптимизирует SoftNDCG вместо NDCG.
  - дискретный список->непрерывное пространство распределений перестановок
    - ListNet
  - дискретный порядок->скрытая случ. величина со своим распределением
    - LambdaLoss

### LambdaRank

- Пусть Q мера качества списка (в оригинале NDCG).
- Оценим  $\Delta Q_{ij}$  при  $x_i \leftrightarrow x_j$ .
- RankNet->LambdaRank:

$$w := w + \frac{\varepsilon \alpha |\Delta Q_{ij}| (x_j - x_i)}{1 + e^{+\alpha (w^T x_j - w^T x_i)}}$$

- Изменение w выше для существенных изменений  $Q_{ii}$ .
  - на рисунке-черные: градиенты RankNet, красные: градиенты LambdaRank (начало списка для Q важнее)
- Приближенно оптимизирует Q.

## Содержание

- 1 Постановка задачи
- 2 Формирование вектора признаков
- Поточечные (pointwise) методы
- 4 Попарные (pairwise) методы
- 5 Списочные (listwise) методы
- 6 Меры качества ранжирования
  - Меры качества для бинарной релевантности
  - Меры качества для градаций релевантности

- 6 Меры качества ранжирования
  - Меры качества для бинарной релевантности
  - Меры качества для градаций релевантности

# Меры качества для бинарной релевантности

- Рассмотрим бинарную разметку  $y \in \{1,0\}$  (релевантен/не релевантен) и запрос q среди всех запросов Q.
- На практике важны лишь первые N документов выдачи
- Предполагаем,  $y_1, y_2, ...$  упорядочены по ↓  $f_w(x)$

- Рассмотрим бинарную разметку  $y \in \{1,0\}$  (релевантен/не релевантен) и запрос q среди всех запросов Q.
- На практике важны лишь первые N документов выдачи
- Предполагаем,  $y_1, y_2, ...$  упорядочены по  $\downarrow f_w(x)$
- ullet Доля корректных пар  $= AUC(q) \ [i,j$  первые N док-тов]

$$ConcordantRatio(q) = \frac{|\{(i,j): i \prec j, \text{ HO } f_w(x_j) < f_w(x_i)\}|}{|\{(i,j): i \prec j\}|}$$

- Рассмотрим бинарную разметку  $y \in \{1,0\}$  (релевантен/не релевантен) и запрос q среди всех запросов Q.
- На практике важны лишь первые N документов выдачи
- Предполагаем,  $y_1, y_2, ...$  упорядочены по  $\downarrow f_w(x)$
- ullet Доля корректных пар  $= AUC(q) \ [i,j$  первые N док-тов]

$$ConcordantRatio(q) = \frac{|\{(i,j): i \prec j, \text{ HO } f_w(x_j) < f_w(x_i)\}|}{|\{(i,j): i \prec j\}|}$$

$$Precision@N(q) = rac{\sum_{n=1}^{N} y_n}{N}$$
 - не учитывает порядок

- Рассмотрим бинарную разметку  $y \in \{1,0\}$  (релевантен/не релевантен) и запрос q среди всех запросов Q.
- На практике важны лишь первые N документов выдачи
- Предполагаем,  $y_1, y_2, ...$  упорядочены по  $\downarrow f_w(x)$
- ullet Доля корректных пар  $= AUC(q) \ [i,j$  первые N док-тов]

$$ConcordantRatio(q) = \frac{|\{(i,j): i \prec j, \text{ HO } f_w(x_j) < f_w(x_i)\}|}{|\{(i,j): i \prec j\}|}$$

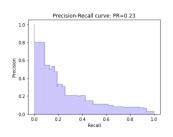
$$Precision@N(q) = rac{\sum_{n=1}^{N} y_n}{N}$$
 - не учитывает порядок

$$RR(q) = \frac{1}{\min_i y_i = 1}; \quad MRR = \frac{1}{|Q|} \sum_{q \in Q} RR(q)$$
 - mean reciprocal rank

MRR на удивление хорошо ранжирует весь список на практике.

 Средняя точность=площадь под Precision-Recall кривой для первых N документов:

$$AP@N(q) = \frac{\sum_{n=1}^{N} y_n}{\sum_{k=1}^{N} y_k} Prec@n(q)$$



$$AP@N(q) = \sum_{n=1}^{N} \left( Recall@(n, N)(q) - Recall@(n-1, N)(q) \right) Prec@n(q)$$

Усредненная AP@n(q) по запросам - mean average precision:

$$MAP@N = rac{1}{|Q|} \sum_{q \in Q} AP@N(q)$$

# Пример расчетов метрик качества

### Результаты ранжирования:

· cojiisiaisi paiiiinpesaiiiiii					
n	$f_w(x)$	у	Prec@n		
1	1 100 2 52 3 3		1		
2			1/2		
3			2/3		
4	-200	1	3/4		

• 
$$RR = 1/1 = 1$$

• 
$$Recall@(1,4) = 1/3$$

• 
$$Recall@(3,4) = 2/3.$$

• 
$$AP@3 = \frac{1}{3}(1+2/3)$$

• 
$$AP@4 = \frac{1}{3}(1 + 2/3 + 3/4)$$

Меры качества для градаций релевантности

- 6 Меры качества ранжирования
  - Меры качества для бинарной релевантности
  - Меры качества для градаций релевантности

### Discounted Cumulative Gain

Discounted Cumulative Gain

$$DCG@N(q) = \sum_{n=1}^{N} g(y_n) d(n)$$

- ullet  $g(y) \geq 0$  и  $\uparrow$  поощрение за релевантность
- ullet  $d(n) \geq 0$  и  $\uparrow$  дисконт за низкую позицию
- Классический выбор:

$$g(y) = 2^{y} - 1$$
,  $d(n) = \frac{1}{\log(i+1)}$ 

•  $DCG@N(q) \ge 0$  неинтерпретируем и несравним для разных N, поэтому используют normalized DCG:

$$nDCG@N(q) = \frac{DCG@N(q)}{IdealDCG@N(q)} \in [0, 1]$$

# Пример расчетов метрик качества

### Результаты ранжирования:

n	$f_w(x)$	у	$g(y) = y^2$	d(n) = 1/n
1	100	3	9	1
2	52	4	16	1/2
3	3	0	0	1/3
4	-200	6	36	1/4

• 
$$DCG@4(q) = 9 \cdot 1 + 16 \cdot \frac{1}{2} + 36 \cdot \frac{1}{4} = 9 + 8 + 9 = 26$$

• IdealDCG@4(q) = 
$$36 \cdot 1 + 16 \cdot \frac{1}{2} + 9 \cdot \frac{1}{3} = 36 + 8 + 3 = 47$$

• 
$$nDCG@4(q) = 26/47$$

Ранжирование - Виктор Китов Меры качества ранжирования

Меры качества для градаций релевантности

### pFound

- Мера качества pFound придумана в Яндексе.
- ullet  $y \in [0,1]$  вероятность найти ответ в документе
- $p_{out}$  вероятность прекратить поиск
- $p_i$  вероятность, что пользователь дойдет до i-й позиции выдачи.

### pFound

- Мера качества pFound придумана в Яндексе.
- ullet  $y \in [0,1]$  вероятность найти ответ в документе
- $p_{out}$  вероятность прекратить поиск
- $p_i$  вероятность, что пользователь дойдет до i-й позиции выдачи. Считается рекуррентно:

$$p_1 = 1$$
 $p_{i+1} = p_i(1 - y_i)(1 - p_{out})$ 

• Т.е. пользователь доходит до (i+1)-й позиции, если он дошел до i-й, не нашел ответ и не прекратил поиск.

$$pFound@N(q) = \sum_{n=1}^{N} p_n y_n$$

• В конце усредняем pFound по запросам.

### Заключение

- Задача ранжирования упорядочивание объектов по их релевантности поисковому запросу.
  - веб-страницы, ответы на вопросы, товары в магазине
- Признаки сочетают информацию о пользователе, запросе и документе.
  - PageRank-популярный способ рейтингования веб-страниц
- Методы ранжирования:
  - поточечные, попарные, списочные (самые точные)
  - порядковая регрессия: метод классификации упорядоченных классов
- Меры качества:
  - инвариантные к порядку среди первых N документов:
    - concordance ratio, precision, recall
  - зависящие от порядка:
    - mean average precision, nDCG, pFound.
  - mean reciprocal rank учитывает только 1й релевантный документ, но хорошо ранжирует в целом.