

# Сборник задач по курсу "Машинное обучение"

авторы: Кантонистова Е.О., Титов В.В., Широков А., Поликарпов К.

15 октября 2020 г.

## Содержание

|          |  |          |
|----------|--|----------|
| <b>1</b> | <b>Матричное дифференцирование</b>     | <b>2</b> |
| 1.1      | Теория . . . . .                       | 2        |
| 1.2      | Семинар . . . . .                      | 2        |
| 1.3      | Домашнее задание . . . . .             | 2        |
| <b>2</b> | <b>Линейные классификаторы часть 1</b> | <b>4</b> |
| 2.1      | Семинар . . . . .                      | 4        |
| 2.2      | Домашнее задание . . . . .             | 4        |
| <b>3</b> | <b>Линейные классификаторы часть 2</b> | <b>6</b> |
| 3.1      | Семинар . . . . .                      | 6        |
| 3.2      | Домашнее задание . . . . .             | 7        |

# 1 Матричное дифференцирование

## 1.1 Теория

Иногда при взятии производных по вектору или от вектор-функций удобно оперировать матричными операциями. Это сокращает запись и упрощает вывод формул. Введём следующие определения:

- При отображении вектора в число  $f(x) : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$   
 $\nabla_x f(x) = [\frac{\partial f}{\partial x_1}, \dots, \frac{\partial f}{\partial x_n}]^T$ .
- При отображении матрицы в число  $f(A) : \mathbb{R}^{n \times m} \rightarrow \mathbb{R}$   
 $\nabla_A f(A) = (\frac{\partial f}{\partial A_{ij}})_{i,j=1}^{n,m}$ .

Мы хотим оценить, как функция изменяется по каждому из аргументов по отдельности. Поэтому производной функции по вектору будет вектор, по матрице — матрица.

Полезные свойства:

- 1)  $d(XY) = dX \cdot Y + X \cdot dY$
- 2) Если  $A$  - матрица константа, то  $dA = 0$
- 3)  $d(X') = dX'$
- 4)  $d \det X = \det X \operatorname{tr}(X^{-1}dX)'$

## 1.2 Семинар

**Задача 1.1.** Пусть  $a \in \mathbb{R}^n$  – вектор параметров, а  $x \in \mathbb{R}^n$  – вектор переменных. Необходимо найти производную их скалярного произведения по вектору переменных  $\nabla_x a^T x$ .

**Задача 1.2.** Пусть  $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ . Необходимо найти  $\nabla_A \det A$ .

**Задача 1.3.** Пусть  $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ ,  $B \in \mathbb{R}^{n \times n}$ . Необходимо найти  $\nabla_A \operatorname{tr}(AB)$ .

**Задача 1.4.** Пусть  $x \in \mathbb{R}^n$ ,  $A \in \mathbb{R}^{n \times m}$ ,  $y \in \mathbb{R}^m$ . Необходимо найти  $\nabla_A x^T A y$ .

## 1.3 Домашнее задание

**Задача 1.5.** Пусть  $t$  – скалярная переменная,  $r$ ,  $s$  – векторные переменные,  $R$ ,  $S$  – матричные переменные. Кроме того,  $a$ ,  $b$  – векторы констант,  $A$ ,  $B$  – матрицы констант. Применив базовые правила дифференцирования найдите:

1.  $d(ARB)$
2.  $d(r'r)$

3.  $d(r'Ar)$
4.  $d(R^{-1})$ , воспользовавшись тем, что  $R^{-1}R = I$
5.  $d(\cos(r'r))$
6.  $d(r'Ar/r'r)$

**Задача 1.6.** Пусть  $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ . Необходимо найти  $\nabla_x x^T Ax$

## 2 Линейные классификаторы часть 1

### 2.1 Семинар

**Задача 2.1.** Линейный классификатор выдал следующие значения для объектов из набора данных:  $b_i = \mathbb{P}(y_i = 1|x_i)$ .

| $y_i$ | $b_i$ |
|-------|-------|
| 1     | 0.7   |
| -1    | 0.2   |
| -1    | 0.3   |
| -1    | 0.8   |
| 1     | 0.6   |

Необходимо:

1. Построить ROC-кривую
2. Найти площадь под ROC-кривой и индекс Джини
3. Построить PR-кривую (кривая точность-полнота)
4. Найти площадь под PR-кривой

**Задача 2.2.** Дан алгоритм классификации, который выдаёт вероятность принадлежности объекта к положительному классу  $b_i = \mathbb{P}(y_i = 1|x_i)$ . Также есть набор данных с объектами двух типов: 100 китов и 900 муравьёв. В качестве признака алгоритм использует количество глаз у объекта (у китов и муравьёв 2 глаза). После применения алгоритма к набору данных для каждого объекта было получено число  $b_i = f(x_i) \in [0; 1]$ , оценка вероятности того, что наблюдение является китом.

Решите задачу минимизации эмпирической функции риска и найдите все  $b_i$  для функций потерь:

1.  $L(y_i, b_i) = (y_i - b_i)^2$ , если для муравьёв  $y_i = 0$ ;
2.  $L(y_i, b_i) = |y_i - b_i|$ , если для муравьёв  $y_i = 0$ ;

### 2.2 Домашнее задание

**Задача 2.4.** Рассмотрим плоскость в  $\mathbb{R}^3$ , задаваемую уравнением  $5x_1 + 6x_2 - 7x_3 + 10 = 0$  и две точки,  $A = (2, 1, 4)$  и  $B = (4, 0, 4)$ .

1. Найдите любой вектор, перпендикулярный плоскости;
2. Правда ли, что отрезок  $AB$  пересекает плоскость?
3. Найдите длину отрезка  $AB$ ;
4. Не находя расстояние от точек до плоскости, определите, во сколько раз точка  $A$  дальше от плоскости, чем точка  $B$ ;

5. Найдите расстояние от точки  $A$  до плоскости.

**Задача 2.5.** Закончите предложения:

1. ассигасу — это доля правильных ответов. . .
2. точность (precision) — это доля правильных ответов. . .
3. полнота (recall) — это доля правильных ответов. . .
4. TPR — это доля правильных ответов. . .

**Задача 2.6.** Алгоритм бинарной классификации выдаёт оценки вероятности  $b_i = \mathbb{P}(y_i = 1|x_i)$ . Всего проведено 10000 наблюдений. Если ранжировать их по возрастанию  $b_i$ , то окажется что наблюдения с  $y_i = 1$  занимают ровно места с 5501 по 5600. Найдите площадь по ROC-кривой и площадь под PR-кривой.

**Задача 2.7.** Для условия задачи 2.2. минимизируйте эмпирическую функцию риска и найдите все  $b_i$  для функций потерь:

$$1. L(y_i, b_i) = \begin{cases} -\log b_i, & \text{если } y_i = 1 \\ -\log (1 - b_i), & \text{иначе} \end{cases} ;$$

$$2. L(y_i, b_i) = \begin{cases} 1/b_i, & \text{если } y_i = 1 \\ 1/(1 - b_i), & \text{иначе} \end{cases} ;$$

## 3 Линейные классификаторы часть 2

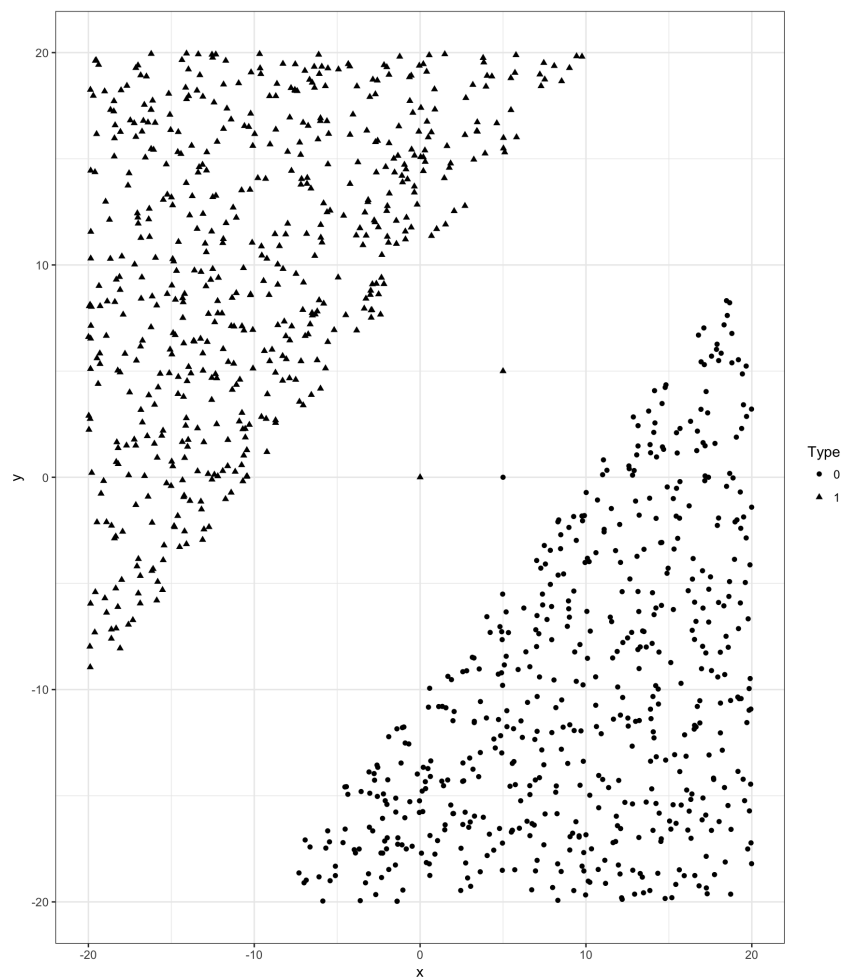
### 3.1 Семинар

**Задача 3.1.** Построить персептон, реализующий логическое ИЛИ.

**Задача 3.2.** На плоскости имеются точки двух цветов. Красные:  $(1, 1)$ ,  $(1, -1)$  и синие:  $(-1, 1)$ ,  $(-1, -1)$ .

1. Найдите разделяющую полосу методом опорных векторов при разных  $C$ ;
2. Укажите опорные вектора.

**Задача 3.3.** По картинке качественно решите задачу разделения точек:



Целевая функция имеет вид:

$$\min_{w, w_0} \frac{1}{2} w' w + C \sum_{i=1}^n \epsilon_i$$

Уравнение разделяющей поверхности:  $w'x = w_0$ , уравнения краёв полосы:  $w'x = w_0 + 1$  и  $w'x = w_0 - 1$ . Нарушителями считаются наблюдения, которые попали на нейтральную полосу или на чужую территорию. Здесь  $\epsilon_i = |w| \cdot d_i$ , где  $d_i$  - заступ наблюдения за черту.

1. Как пройдёт разделяющая полоса при  $C = 1$ ? Найдите  $w, w_0$ , величины штрафов  $\epsilon_i$ .
2. Как пройдёт разделяющая полоса при  $C = +\infty$ ? Найдите  $w, w_0$ , величины штрафов  $\epsilon_i$ .

**Задача 3.4.** Дана таблица сопряженности  $x$  и  $y$ :

|           | $y_i = 1$ | $y_i = 0$ |
|-----------|-----------|-----------|
| $x_i = 1$ | 12        | 36        |
| $x_i = 0$ | 32        | 20        |

Будем использовать логистическую регрессию с константой для прогнозирования  $y$  с помощью  $x$ .

1. Какие оценки коэффициентов мы получим?
2. Какой прогноз вероятности  $y = 1$  при значении признака  $x = 0$  даёт логистическая модель? Как это число можно посчитать без рассчитывания коэффициентов?

**Задача 3.5.** Показать, что из формулы логистической регрессии

$$p(y = +1|x) = \frac{1}{1 + e^{-w^T x}}$$

следует, что  $(w, x)$  - это логарифм отношения шансов (log-odds).

**Задача 3.6.** Показать, что квадратичная функция потерь

$$L(y, z) = ([y = +1] - z)^2$$

позволяет предсказывать корректные вероятности.

## 3.2 Домашнее задание

**Задача 3.7.** Построить перцептон, реализующий логическое ИЕ.

**Задача 3.8.\*** Построить двухслойный перцептон, реализующий XOR.

**Задача 3.9.** На плоскости имеются точки двух цветов. Красные:  $(1, 1)$ ,  $(1, -1)$  и синие:  $(-1, 1)$ ,  $(-1, -1)$  и  $(2, 0)$ .

1. Найдите разделяющую гиперплоскость методом опорных векторов при разных  $C$ .
2. Укажите опорные вектора.

**Задача 3.10.** Покажите, что абсолютная функция потерь

$$L(y, z) = |[y = +1] - z|, \quad z \in [0; 1]$$

не позволяет предсказывать корректные вероятности.

**Задача 3.11.** Рассмотрим целевую функцию логистической регрессии с константой

$$Q(w) = \frac{1}{l} \sum_{i=1}^n L(y_i, b_i),$$

где  $b_i = 1 / (1 + \exp(-\langle w, x_i \rangle))$  и  $L(y_i, b_i) = \begin{cases} -\log b_i, & \text{если } y_i = 1 \\ -\log(1 - b_i), & \text{иначе} \end{cases}$

Найдите градиент  $Q(w)$ .

**Задача 3.12.** Оценка логистической модели для прогнозирования  $y_i$ , в зависимости от  $x_i$  и  $z_i$ :  $\ln \text{odds}_i = 2 + 0.3x_i - 0.5z_i$ . Оцените вероятность того, что  $y_i = 1$  для  $x = 15, z = 3.5$ .