

Сборник задач по курсу "Машинное обучение"

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

8 октября 2020 г.

Содержание

1	Матричное дифференцирование	2
1.1	Теория	2
1.2	Семинар	2
1.3	Домашнее задание	2
2	Линейные классификаторы	4
2.1	Семинар	4
2.2	Домашнее задание	4

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

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:

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

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