Алгоритмы анализа данных

function_name? нажать Ctrl+Enter.

Object `np.std` not found.

Чтобы посмотреть исходный код - function_name?? нажать Ctrl+Enter.

Как вызвать справку jupyter notebook? https://ru.stackoverflow.com/questions/629610/%D0%9A%D0%B0%D0%BA-%D0%B2%D1%8B%D0%B7%D0%B2%D0%B0%D1%82%D1%8C-%D1%81%D0%BF%D1%80%D0%B0%D0%B2%D0%BA%D1%83-jupyter-notebook)

```
B [1]: # Compute the arithmetic mean (среднее арифметическое) along the specified axis.

np.mean?

Object `np.mean` not found.

B [2]: # Compute the standard deviation (стандартное отклонение) along the specified axis.

np.std??
```

Урок 3. Логистическая регрессия. Log Loss

Практическое задание

- 1*. Измените функцию calc_logloss так, чтобы нули по возможности не попадали в np.log.
- 2. Подберите аргументы функции eval_model для логистической регрессии таким образом, чтобы log loss был минимальным.
- **3.** Создайте функцию calc_pred_proba, возвращающую предсказанную вероятность класса 1 (на вход подаются W, который уже посчитан функцией eval_model и X, на выходе массив y_pred_proba).
- **4.** Создайте функцию calc_pred, возвращающую предсказанный класс (на вход подаются W, который уже посчитан функцией eval_model и X, на выходе массив y_pred).
- **5.** Посчитайте Accuracy, матрицу ошибок, точность и полноту, а также F1 score.
- 6. Могла ли модель переобучиться? Почему?
- 7*. Создайте функции eval_model_I1 и eval_model_I2 с применением L1 и L2 регуляризаций соответственно.

```
B [7]: # Масштабируем матрицу признаков
X_st = X.copy()
X_st[2, :] = calc_std_feat(X[2, :])
```

```
B [8]: X_st
Out[8]: array([[ 1.
                                    , 1.
                                                                       ],
             [ 1.
                                               , 1.
                                    , 10.
                                               , 1.
             [-0.97958969, -0.56713087, -0.46401617, -0.77336028, 0.97958969,
              -0.36090146, 1.08270439, 2.11385144, -1.08270439, 0.05155735],
                     , 1.
                                            , 1.
                               , 2.
             [ 1.
                                   , 3.
                                              , 1.
                                                                       ]])
```

1*. Задача:

Измените функцию calc_logloss так, чтобы нули по возможности не попадали в np.log.

Изменяем функцию calc_logloss так, чтобы нули по возможности не попадали в np.log.

```
В [10]: # Изменённый вариант функции
        def calc_logloss(y, y_pred):
            Логарифмическая функция потерь (нули не попадают в np.log.)
            у - вектор истинных значений
            y_pred = P+ вероятность отнесения объекта к классу +1: P(y=1|x)
            z_y_pred = np.array([]) # Новый массив предсказанных знгачений
            z_y = np.array([]) # Новый массив истинных значений
            # Исключаем 0 и 1 из матрицы признаков
            for i in range(len(y_pred)):
                if (y_pred[i] != 0) and (y_pred[i] != 1):
                    z_y_pred = np.append(z_y_pred, y_pred[i])
                    z_y = np.append(z_y, y[i])
            # print(len(y_pred), len(z_y_pred), z_y_pred, z_y)
            err = - np.mean(z_y * np.log(z_y_pred) + (1.0 - z_y) * np.log(1.0 - z_y_pred))
            return err
В [11]: |# Проверка
        y_1 = np.array([0, 1], dtype = np.float64)
        y_pred_1 = np.array([0, 0.1], dtype = np.float64)
```

```
Out[11]: 2.3025850929940455
```

calc_logloss(y_1, y_pred_1)

2. Задача:

Подберите аргументы функции eval_model для логистической регрессии таким образом, чтобы log loss был минимальным.

```
\alpha \cdot \nabla_w Q(w,X)
```

```
B [12]: ### Logistic Regression
```

```
B [13]: | def eval_model(X, y, iterations, alpha=1e-4):
            Обучаем модель методом градиентного спуска
            iterations - количество итераций (условие прерывания алгоритма)
            alpha - скорость обучения
            1 \cdot 1 \cdot 1
            # задаем начальные условия для генератора случайных чисел (повторяемость результата).
            np.random.seed(42)
            # сгенерируем вектор истинных весов
            # возвращаем несколько значений выборки из стандартного нормального распределения (X.shape[0]=4).
           W = np.random.randn(X.shape[0])
           n = X.shape[1]
            # ход градиентного спуска
            for i in range(1, iterations+1):
                # делаем предсказание z=W*X (умножаем вектор W на матрицу признаков X
                z = np.dot(W, X)
                # переводим значения z в вероятности (от 0 до 1)
                y_pred = sigmoid(z)
                # Вычисляем ошибку на i шаге Q(w,X)
                err = calc_logloss(y, y_pred)
                # Вычисляем новое значение вектора весов W_new = W - \alpha \cdot \nabla w(Q(w,X))
                W -= alpha * (1/n * np.dot((y_pred - y), X.T))
            if i % (iterations / 10) == 0:
                print(f'i={i}, W={W}, err={err:.6f}')
            return W
B [14]: # Неизменённая функция calc_logloss(y, y_pred):
        # W - истинный вектор весов
        W = eval_model(X_st, y, iterations=1000, alpha=1e-5)
        W = eval_model(X_st, y, iterations=10000, alpha=1e-5)
        W = eval_model(X_st, y, iterations=100000, alpha=1e-5)
        i=1000, W=[ 0.49282757 -0.15007512 0.64748969 1.51727928], err=1.201313
        i=100000, W=[ 0.25809285 -0.68188567 0.6883469 1.2412009 ], err=0.590673
B [15]: W = eval_model(X_st, y, iterations=1000, alpha=1e-1)
        W = eval_model(X_st, y, iterations=10000, alpha=1e-1)
        W = eval_model(X_st, y, iterations=100000, alpha=1e-1)
        i=1000, W=[-2.77136565 -0.99588853 0.56641089 3.26813012], err=0.405878
        i=10000, W=[-11.27241705 -1.45342424 -2.38315559 9.49424167], err=0.252383
        i=100000, W=[-35.8933164 -3.59426199 -9.64639296 29.4060647 ], err=0.116671
B [16]: W = eval_model(X_st, y, iterations=1000, alpha=1)
        W = eval_model(X_st, y, iterations=10000, alpha=1)
        W = eval_model(X_st, y, iterations=100000, alpha=1)
        i=1000, W=[-11.32397854 -1.45756231 -2.39926134 9.53555126], err=0.251910
        i=10000, W=[-35.907977
                               -3.59554341 -9.65060282 29.4178451 ], err=0.116635
        i=100000, W=[-92.66076921 -7.66670016 -26.4910003 73.04818885], err=0.058652
B [17]: |W = eval_model(X_st, y, iterations=1000, alpha=10)
        W = eval_model(X_st, y, iterations=10000, alpha=10)
        W = eval_model(X_st, y, iterations=100000, alpha=10)
        i=1000, W=[-66.16086473 -5.98161889 -18.47262793 53.1178605 ], err=0.076037
        i=10000, W=[-105.55021441 -8.45937948 -30.41007429 82.68946134], err=0.055788
        i=100000, W=[-223.45481242 -15.7557359 -66.20940672 170.97169205], err=0.009551
```

Вывод:

log loss минимальный при:

Скорость обучения α =10, Количество итераций **i**=100000, Вектор весов **W**=[-223.45481242 -15.7557359 -66.20940672 170.97169205], Ошибка **err**=0.009551

3. Задача:

Создайте функцию calc_pred_proba, возвращающую предсказанную вероятность класса 1 (на вход подаются W, который уже посчитан функцией eval_model и X, на выходе - массив y_pred_proba).

4. Задача:

Создайте функцию calc_pred, возвращающую предсказанный класс (на вход подаются W, который уже посчитан функцией eval_model и X, на выходе - массив у_pred).

```
B [20]: def calc_pred(W, X, porog):
    ''' Возвращающую предсказанную вероятность класса 1 '''

y_pred = np.array([])
z = np.dot(W, X)
y_pred_proba = sigmoid(z)

for i in range(len(y_pred_proba)):
    if (y_pred_proba[i] > porog):
        y_pred = np.append(y_pred, 1)
    else:
        y_pred = np.append(y_pred, 0)

return y_pred
```

5. Задача:

Посчитайте Accuracy, матрицу ошибок, точность и полноту, а также F1 score.

Доля правильных ответов (Accuracy):

$$accuracy(a, x) = \frac{1}{l} \sum_{i=1}^{l} [a(x_i) = y_i].$$

```
В [25]: # В нашем случае у нас есть
         accuracy = calc_accuracy(y, W, X_st, 0.5)
         accuracy
Out[25]: 0.8
 В [26]: # Проверка
         import sklearn.metrics
         from sklearn.metrics import accuracy_score
 B [27]: y_pred
Out[27]: array([0., 0., 1., 0., 1., 1., 0., 0., 1.])
 B [28]: | acc = accuracy_score(y, y_pred)
         acc
Out[28]: 0.8
```

Матрица ошибок (Confusion matrix)

```
y = +1 y = -1
a(x) = +1
              TP
                       FΡ
a(x) = -1
              FΝ
                       TN
```

```
B [29]: def calc_confusion_matrix(y_true, y_pred):
            ''' Вычисляем матрицу ошибок (confusion matrix)
            для двух np.arrays true и pred.
            "from sklearn.metrics import confusion_matrix"
            K = len(np.unique(y_true)) # Number of classes
            res = np.zeros((K, K))
            for i in range(len(y_true)):
                res[int(y_true[i])][int(y_pred[i])] += 1
            return res
```

```
В [30]: # Вычисляем матрицу ошибок для нашего случая
        conf_matrix = calc_confusion_matrix(y, y_pred)
        conf_matrix
```

```
Out[30]: array([[4., 1.],
                [1., 4.]]
```

```
В [31]: # Проверка
        from sklearn.metrics import confusion_matrix
        confusion_matrix(y, y_pred)
```

```
Out[31]: array([[4, 1],
                [1, 4]], dtype=int64)
```

Результаты совпадают

Точность (Precision) - доля истинных срабатываний от общего количества срабатываний.

$$precision(a, X) = \frac{TP}{TP + FP}$$

```
B [32]: precision = conf_matrix[0][0]/(conf_matrix[0][0] + conf_matrix[0][1])
        precision
```

```
Out[32]: 0.8
```

```
В [33]: # Проверка
        from sklearn.metrics import precision_score
        precision = precision_score(y, y_pred, pos_label=1)
        precision
```

Out[33]: 0.8

Полнота (Recall) - доля объектов, истинно относящихся к классу "+1", которые алгоритм отнес к этому классу

$$recall(a, X) = \frac{TP}{TP + FN},$$

```
B [34]: recall = conf_matrix[0][0]/(conf_matrix[0][0] + conf_matrix[1][0])
recall

Out[34]: 0.8

B [35]: # Προθερκα
from sklearn.metrics import recall_score
recall = recall_score(y, y_pred, pos_label=1)
recall

Out[35]: 0.8
```

F-мера (F1 score)

```
F = \frac{2 \cdot precision \cdot recall}{presision + recall}.
```

```
B [36]: F = 2*(precision*recall)/(precision + recall)
F
```

Out[36]: 0.8000000000000000

```
B [37]: # Проберка
# sklearn.metrics.f1_score - https://scikit-learn.org/stable/modules/generated/sklearn.metrics.f1_score.html
from sklearn.metrics import f1_score
f1_score(y, y_pred, average='macro')
```

Out[37]: 0.8000000000000002

6. Задача:

Могла ли модель переобучиться? Почему?

Переобучение - модель настроилась на шумы, а не на общие закономерности и тренды.

7*. Задача:

Создайте функции eval_model_l1 и eval_model_l2 с применением L1 и L2 регуляризаций соответственно.

L1-регуляризация способствует разреженности функции, когда лишь немногие факторы не равны нулю.

L2-регуляризация способствует появлению малых весовых коэффициентов модели, но не способствует их точному равенству нулю.

Оба метода помогают улучшить обобщение и ошибки, поскольку не допускают переобучения модели из-за шума в данных.

При L2-регуляризации дополнительный член является квадратичной функцией, при L1-регуляризации – модулем.

При квадратичном члене, чем ближе вы находитесь к нулю, тем меньшей становится ваша производная, пока также не приблизится к нулю. Поэтому при L2-регуляризации, когда ваша величина w уже мала, дальнейший градиентный спуск уже её сильно не изменит. В случае модуля производная является константой с абсолютной величиной, равной единице. Формально в нуле она не определена, но мы считаем её также равной нулю. Поэтому при L1-регуляризации градиентный спуск будет стремиться к нулю с постоянной скоростью, а достигнув его, там и останется. Вследствие этого L2-регуляризация способствует малой величине весовых коэффициентов, а L1-регуляризация способствует их равенству нулю, тем самым провоцируя разрежённость.

Можно включить в свою модель сразу и L1, и L2-регуляризации. Такая модель даже имеет специальное название – **ElasticNet**. Это просто добавление и штрафа L1-регуляризации, и штрафа L2-регуляризации к вашей функции затрат.

$$J_{RIDGE} = J + \lambda_2 |w|^2$$

$$J_{LASSO} = J + \lambda_1 |w|$$

$$J_{ELASTICNET} = J + \lambda_1 |w| + \lambda_2 |w|^2$$

```
B [51]: # W - истинный вектор весов

W = eval_model(X_st, y, iterations=1000, alpha=1e-5)

W = eval_model(X_st, y, iterations=10000, alpha=1e-5)

W = eval_model(X_st, y, iterations=100000, alpha=1e-5)

i=1000, W=[ 0.49282757 -0.15007512  0.64748969  1.51727928], err=1.201313

i=10000, W=[ 0.45886981 -0.25439705  0.6453131  1.46695998], err=1.039365

i=100000, W=[ 0.25809285 -0.68188567  0.6883469  1.2412009 ], err=0.590673

B [52]: # Returns an element-wise indication of the sign of a number.

# Функция sign(x) возвращает единицу, если x>0, минус единицу, если x<0, и нуль, если x=0.

пр.sign??
```

```
B [53]: def eval_model_l1(X, y, iterations, alpha=1e-4):
             Градиентный спуск
             L1-регуляризация
             iterations - количество итераций (условие прерывания алгоритма)
             alpha - скорость обучения
             \mathbf{r}_{-1}, \mathbf{r}_{-1}
             # задаем начальные условия для генератора случайных чисел (повторяемость результата).
             np.random.seed(42)
             # сгенерируем вектор истинных весов
             # возвращаем несколько значений выборки из стандартного нормального распределения (X.shape[0]=4).
            W = np.random.randn(X.shape[0])
            n = X.shape[1]
             # ход градиентного спуска
             for i in range(1, iterations+1):
                 # делаем предсказание z=W*X (умножаем вектор W на матрицу признаков X
                 z = np.dot(W, X)
                 # переводим значения z в вероятности (от 0 до 1)
                 y_pred = sigmoid(z)
                 # Вычисляем ошибку на i шаге Q(w,X)
                 err = calc_logloss(y, y_pred)
                 # Вычисляем новое значение вектора весов (L2-регуляризация) \mathsf{W}_{-}ne\mathsf{w} = \mathsf{W} - \alpha \cdot \nabla w(Q(w,X)) + Lambda*|\mathsf{W}|
                 W = alpha * (1/n * np.dot((y_pred - y), X.T) + 2*np.sign(W))
             if i % (iterations / 10) == 0:
                 print(f'i={i}, W={W}, err={err:.6f}')
             return W
В [54]: # W - истинный вектор весов
        W = eval_model_l1(X_st, y, iterations=1000, alpha=1e-5)
        W = eval_model_l1(X_st, y, iterations=10000, alpha=1e-5)
        W = eval_model_l1(X_st, y, iterations=100000, alpha=1e-5)
        i=1000, W=[ 0.4728311 -0.13007488 0.627488
                                                          1.49728315], err=1.205278
        i=10000, W=[ 0.25925794 -0.05452568  0.44509247  1.26736528], err=1.080879
        i=100000, W=[ 3.74206502e-06 7.41569932e-06 -1.41768584e-05 -6.88292739e-06], err=0.693145
B [48]: def eval_model_12(X, y, iterations, alpha=1e-4):
             Градиентный спуск
             L2-регуляризация
             iterations - количество итераций (условие прерывания алгоритма)
             alpha - скорость обучения
             1.1.1
             # задаем начальные условия для генератора случайных чисел (повторяемость результата).
             np.random.seed(42)
             # сгенерируем вектор истинных весов
             # возвращаем несколько значений выборки из стандартного нормального распределения (X.shape[0]=4).
            W = np.random.randn(X.shape[0])
            n = X.shape[1]
             # ход градиентного спуска
             for i in range(1, iterations+1):
                 # делаем предсказание z=W^*X (умножаем вектор W на матрицу признаков X
                 z = np.dot(W, X)
                 # переводим значения z в вероятности (от 0 до 1)
                 y_pred = sigmoid(z)
                 # Вычисляем ошибку на i шаге Q(w,X)
                 err = calc_logloss(y, y_pred)
                 # Вычисляем новое значение вектора весов (L2-регуляризация) W_n new = W - \alpha \cdot \nabla w(Q(w,X)) + Lambda*W
                 W -= alpha * (1/n * np.dot((y pred - y), X.T) + 0.1*W)
             if i % (iterations / 10) == 0:
                 print(f'i={i}, W={W}, err={err:.6f}')
             return W
```

В [49]: # W - истинный вектор весов

L1 и L2-регуляризация для логистической регрессии - https://craftappmobile.com/l1-и-l2-регуляризация-для-логистической-регрессии (https://craftappmobile.com/l1-%D0%B8-l2-

%D0%BB%D0%BE%D0%B3%D0%B8%D1%81%D1%82%D0%B8%D1%87%D0%B5%D1%81%D0%BA%D0%BE%D0%B9-

<u>%D1%80%D0%B5%D0%B3%D1%80%D0%B5%D1%81%D1%81%D0%B8%D0%B8)</u>

Обучение логистической регрессии - https://vc.ru/dev/72964-obuchenie-logisticheskoy-regressii (<a href="https:

Оценка моделей ML/DL: матрица ошибок, Accuracy, Precision и Recall - https://pythonru.com/baza-znanij/metriki-accuracy-precision-i-recall (https://pythonru.com/baza-znanij/metriki-accuracy-precision-i-recall)

```
B [38]: import pandas as pd
         y_actu = pd.Series([2, 0, 2, 2, 0, 1, 1, 2, 2, 0, 1, 2], name='Actual')
         y_pred = pd.Series([0, 0, 2, 1, 0, 2, 1, 0, 2, 0, 2, 2], name='Predicted')
         df_confusion_1 = pd.crosstab(y_actu, y_pred),
         df_confusion = pd.crosstab(y_actu, y_pred, rownames=['Actual'], colnames=['Predicted'], margins=True)
         df_confusion, df_confusion_1
Out[38]: (Predicted 0 1 2 All
          Actual
          0
                     3 0 0
                                3
          1
                     0 1 2
                                3
          2
                     2 1 3
          All
                     5 2 5
                               12,
          (Predicted 0 1 2
           Actual
           0
                      3 0 0
                      0 1 2
           1
           2
                      2 1 3,))
 В [39]: #Вы также можете получить нормализованную матрицу путаницы, используя:
         df_conf_norm = df_confusion / df_confusion.sum(axis=1)
         df_conf_norm
Out[39]:
          Predicted
                                1
                                        2
                                             ΑII
            Actual
                0 0.500000 0.000000 0.000000 0.125
```

0.000000 0.166667 0.166667 0.125

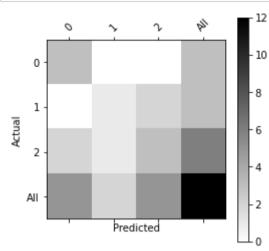
2 0.333333 0.166667 0.250000 0.250 **All** 0.833333 0.333333 0.416667 0.500

```
B [40]: # Вы можете построить эту confusion_matrix с помощью

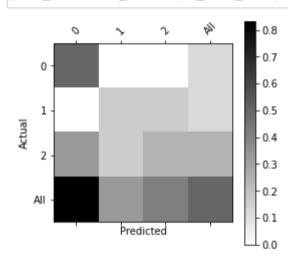
import matplotlib.pyplot as plt

def plot_confusion_matrix(df_confusion, title='Confusion matrix', cmap=plt.cm.gray_r):
    plt.matshow(df_confusion, cmap=cmap) # imshow
    #plt.title(title)
    plt.colorbar()
    tick_marks = np.arange(len(df_confusion.columns))
    plt.xticks(tick_marks, df_confusion.columns, rotation=45)
    plt.yticks(tick_marks, df_confusion.index)
    #plt.tight_Layout()
    plt.ylabel(df_confusion.index.name)
    plt.xlabel(df_confusion.columns.name)

plot_confusion_matrix(df_confusion)
```



B [41]: plot_confusion_matrix(df_conf_norm)



в[]: