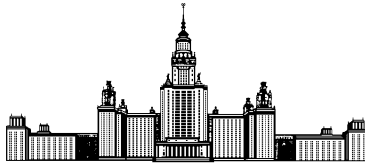


Московский государственный университет имени М. В. Ломоносова



Факультет Вычислительной Математики и Кибернетики

Кафедра Математических Методов Прогнозирования

## КУРСОВАЯ РАБОТА СТУДЕНТА 317 ГРУППЫ

### «Сравнительный анализ методов быстрого поиска ближайших соседей»

Выполнил:

студент 3 курса 317 группы

*Федоров Илья Сергеевич*

Научный руководитель:

д.ф.-м.н., профессор

*Дьяконов Александр Геннадьевич*

Заведующий кафедрой

Математических Методов

Прогнозирования, академик РАН

\_\_\_\_\_ Ю. И. Журавлёв

К защите допускаю

«\_\_\_\_\_» \_\_\_\_\_ 2020 г.

К защите рекомендую

«\_\_\_\_\_» \_\_\_\_\_ 2020 г.

Москва, 2020

# Содержание

<b>1</b>	<b>Введение</b>	<b>3</b>
1.1	Определения и обозначения . . . . .	3
1.2	Обзор литературы . . . . .	4
<b>2</b>	<b>Обзор существующих методов поиска ближайших соседей</b>	<b>4</b>
2.1	Прямое вычисление матрицы попарных расстояний . . . . .	4
2.2	Структуры данных . . . . .	6
<b>3</b>	<b>Вычислительные эксперименты</b>	<b>9</b>
3.1	Исходные данные и условия эксперимента . . . . .	9
3.2	Результаты эксперимента . . . . .	9
3.3	Обсуждение и выводы . . . . .	10
<b>4</b>	<b>Заключение</b>	<b>10</b>

## Аннотация

Todo

# 1 Введение

Одним из наиболее простых и естественных методов машинного обучения является метод ближайшего соседа. Имея набор данных, представленных в виде точек в некотором многомерном пространстве, целевая величина (будь то класс или вещественное число) прогнозируется по значениям отклика на  $k$  ближайших к запросу точках из исходного набора данных. В то время как существует множество различных подходов к усреднению данных  $k$  значений, наиболее вычислительно затратной частью алгоритмов подобного типа является именно поиск ближайших соседей. Действительно, в современных задачах объемы данных достигают колоссальных размеров, что делает алгоритмы, основанные на полном переборе, неэффективными. Задача поиска ближайших к запросу точек в некотором наборе данных встречается не только в задачах прогнозирования. Примерами приложений также могут служить задачи поиска дубликатов в больших объемах данных (или «почти» дубликатов), поиска похожих изображений и текстов. Целью данной работы является обзор современных подходов к решению задачи поиска ближайших соседей и её вариаций, а также сравнительный анализ эффективности тех или иных методов её решения в зависимости от особенностей пространства, в котором расположены данные. В исследовании представлены как классические подходы, основанные на формировании некоторых дополнительных структур данных, так и наиболее современные «приближенные» методы.

## 1.1 Определения и обозначения

Формализуем постановку задачи. Основным объектом нашего изучения будет пространство признаков вместе с функцией расстояния  $\mathbb{X} = (\mathbb{R}^n, d)$ . Важно заметить, что функция  $d$  в приложениях довольно часто может не удовлетворять формальному определению метрики, однако даже в этом случае в данной работе подобные функции, допуская некоторую вольность, будут называться метриками. К примеру, широко используемое в анализе текстов косинусное расстояние  $d(x, y) = 1 - \frac{\langle x, y \rangle}{\|x\| \|y\|}$  не удовлетворяет неравенству треугольника. В данной работе в большинстве случаев будет использоваться евклидова метрика и описанное выше косинусное расстояние.

Будем обозначать  $X \in \mathbb{R}^{l \times n}$  матрицу для выборки точек из  $\mathbb{X}$ , где строки соответствуют объектам, а столбцы признаками. Формально задача поиска  $k$  ближайших соседей ставится следующим образом: имея множество объектов  $X$  из пространства  $\mathbb{X}$  и запрос  $q \in \mathbb{X}$ , нужно найти в  $X$   $k$  ближайших к  $q$  точек по метрике  $d$ . Более подробно, если посчитать расстояния между  $q$  и всеми объектами из  $X$ , а потом расположить их в отсортированном порядке

$$d(x_{i_1}, q) \leq d(x_{i_2}, q) \leq \dots \leq d(x_{i_l}, q),$$

то алгоритм должен выдать  $k$  объектов с минимальными расстояниями:  $x_{i_1}, x_{i_2}, \dots, x_{i_k}$ .

Как мы увидим далее, большинство современных методов быстрого поиска ближайших соседей на самом деле решают описанную выше задачу с некоторыми ослаблениями, что в сущности приводит к задаче «приближенного» поиска ближайших соседей. Эта задача не имеет общепризнанной формальной постановки, разные авторы могут по-разному понимать её. К примеру, довольно распространенной постановкой задачи является следующая формулировка: имея набор точек  $X$  из  $\mathbb{X}$ , запрос  $q \in \mathbb{X}$ , а также параметр  $c \geq 1$ , если существует точка  $x \in X$ , такая что  $d(x, q) \leq r$ , алгоритм должен вернуть точку  $x^* \in X$ , такую что  $d(x^*, q) \leq cr$ . В дальнейшем при описании конкретных методов, мы будем уточнять, какую именно задачу приближенного поиска ближайших соседей они решают.

## 1.2 Обзор литературы

todo, напишу после основной части

# 2 Обзор существующих методов поиска ближайших соседей

## 2.1 Прямое вычисление матрицы попарных расстояний

Самым простым и распространенным способом поиска ближайших соседей является прямой перебор. Имея набор данных  $X$  и запрос  $q$ , мы вычисляем расстояния между каждым объектом  $x \in X$  и  $q$ . После этого полученные расстояния сорти-

руются, и алгоритм выдает  $k$  объектов из  $X$ , имеющих наименьшие расстояния до  $q$ .

Оценим вычислительную сложность такого алгоритма. Заметим, что для вычисления евклидового или косинусного расстояния между двумя объектами размерности  $n$  нужно совершить порядка  $n$  операций. Отсюда получаем, что сложность вычисления расстояний  $\mathcal{O}(nl)$  (в наших обозначениях  $l$  – число объектов). Далее требуется отсортировать полученный массив, что займет  $\mathcal{O}(l \log(l))$  операций. Наконец, останется совершить  $\mathcal{O}(k)$  операций для выдачи результата. Учитывая, что  $k \leq l$ , получим итоговую сложность:  $\mathcal{O}(nl + l \log(l))$ . Однако на практике данную сложность можно улучшить. Дело в том, что обычно  $k \ll l$ , а значит бо́льшая часть информации из отсортированного массива нам не нужна. Поэтому вместо сортировки можно использовать более эффективные алгоритмы для поиска  $k$  наименьших чисел в массиве. Например, это можно сделать с помощью структуры данных под названием куча. Имея массив из  $l$  элементов, можно построить кучу за  $\mathcal{O}(l)$ , а далее вытащить из неё  $k$  минимальных элементов за  $\mathcal{O}(\log(l))$  каждый. Получаем сложность поиска  $k$  минимальных чисел в массиве  $\mathcal{O}(l + k \log(l))$ . Учитывая, что  $k \ll l$ , вторым слагаемым можно пренебречь, и оценить итоговую сложность всего алгоритма в  $\mathcal{O}(nl)$ .

Данный алгоритм вполне эффективен и применим, если объем данных и запросов не слишком велик. К примеру, в соревнованиях по машинному обучению довольно часто встречаются наборы данных размером порядка  $10^5 - 10^6$  размерности около 100. Имея обучающую выборку размером  $10^6$  размерности 100, а также тестовую выборку размером  $2 \times 10^6$ , алгоритм прямого перебора будет работать около 13 часов на 8-ядерном процессоре. Это вполне приемливо, если требуется решить задачу для конкретной тестовой выборки. Однако данный алгоритм обладает рядом существенных недостатков. Во-первых, если поиск ближайших соседей проводится для решения какой-то задачи машинного обучения, то все вычисления проводятся непосредственно в момент предсказания целевой величины. Поскольку алгоритм никак не обучается, его ценность с точки зрения производительности существенно падает, так как при каждом предсказании производится набор вычислений, сопоставимый по объему с обучением какого-то другого алгоритма, который, обучившись лишь однажды, может очень быстро выдавать ответы (например, линейная или логистиче-

ская регрессия). Во-вторых, если данных становится действительно много (скажем, больше  $10^{10}$ ), то для хоть сколько-то большой тестовой выборки уже требуется колоссальное количество времени для вычислений. Современные компьютеры могут выполнять примерно  $10^8$  операций в секунду, поэтому для обучающей выборки размером  $10^{10}$  (вполне реальная цифра для больших компаний), тестовой выборки размером  $10^3$ , размерности пространства 10 такое вычисление займет  $\frac{10^{10} \times 10^3 \times 10}{10^8}$  секунд  $\approx 278$  часов  $\approx 12$  дней. Безусловно, эти цифры можно сократить, используя специализированные архитектуры компьютеров и многопоточность, однако представленные два недостатка данного алгоритма в совокупности ставят под сомнение его использование в промышленных масштабах.

## 2.2 Структуры данных

Большой класс алгоритмов для быстрого поиска ближайших соседей основан на идее разбиения признакового пространства на области, которые объединяются в различные структуры данных, позволяющие выполнять поиск ближайших соседей для новых запросов быстрее.

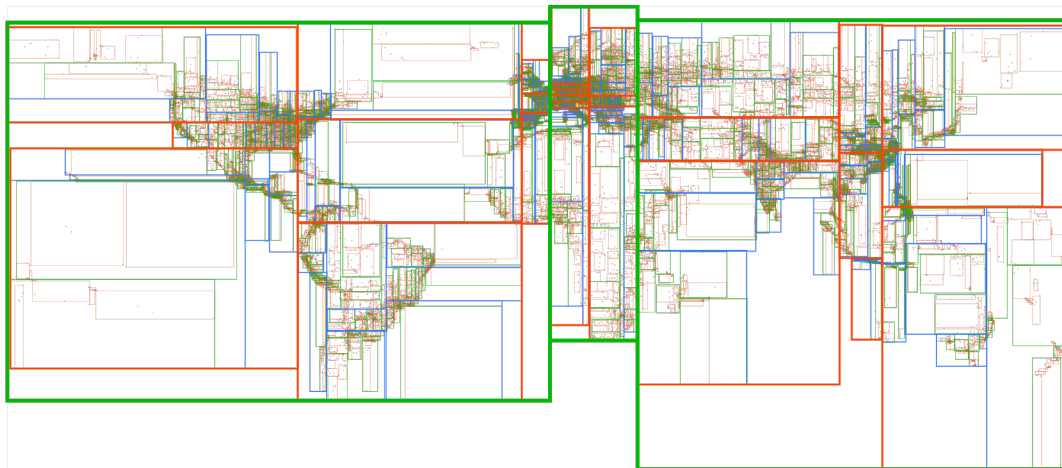


Рис. 1: Пример разбиения данных на плоскости с помощью R-Tree

Большинство алгоритмов из данного класса сначала осуществляют предварительную обработку исходного набора данных, строя древовидные структуры, состоящие из областей разбиений. Далее, при поступлении очередного запроса, используется информация, полученная на первом этапе. Таким образом, важное отличие таких

алгоритмов от метода прямого перебора заключается в том, что теперь мы имеем некоторый разделенный интерфейс, состоящий из двух методов: построение дерева и запрос. Это позволяет нам по отдельности оценивать вычислительные сложности для этих двух операций. Это может иметь важную роль, к примеру, если в решаемой практической задаче не так существенно, сколько займет первичная обработка данных, но требуется высокая скорость обработки новых запросов.

Перечислим наиболее популярные алгоритмы поиска ближайших соседей, основанные на древовидных структурах данных:

- KD - Tree
- Ball - Tree
- R - Tree
- BSP - Tree
- Quadtree
- B - Tree

Стоит отметить, что некоторые из этих структур данных предназначены для работы с данными какой-то фиксированной размерности. Например, B - Tree работает для одномерных данных, а Quadtree – для двумерных. На практике наиболее часто встречаются алгоритмы KD - Tree и Ball - Tree, поскольку они включены в самые известные библиотеки для машинного обучения. Рассмотрим подробнее принципы их работы.

Приведем возможную реализацию KD - Tree на псевдокоде. Сначала рассмотрим операцию построения дерева.

---

```

1: procedure BUILDNODE( $\Omega$ )
2:   if  $|\Omega| \leq n_{min}$  then
3:     self.objects =  $\Omega$ 
4:   else
5:     self.pivot_feature_idx =  $\operatorname{argmax}_{1 \leq i \leq n} \mathbb{D}[x^i]$ 
6:     self.threshold =  $\operatorname{median}(x_k^{\text{self.pivot\_feature\_idx}})$ 
7:     self.left = BUILDNODE( $\{ x_k \in \Omega \mid x_k^{\text{self.pivot\_feature\_idx}} < \text{self.threshold} \}$ )
8:     self.right = BUILDNODE( $\{ x_k \in \Omega \mid x_k^{\text{self.pivot\_feature\_idx}} \geq \text{self.threshold} \}$ )
9:   end if
10: end procedure

```

---



Таким образом, метод разбивает набор данных по медиане признака с наибольшей дисперсией на две части и рекурсивно применяется к каждой из них. Полученные деревья считаются сыновьями данной вершины. Рекурсия прекращается, когда набор данных становится достаточно небольшим по размеру. Отметим, что различных источниках можно найти немного отличающиеся реализации данной операции, однако приведенный вариант хорош тем, что приводит к достаточно сбалансированному дереву.

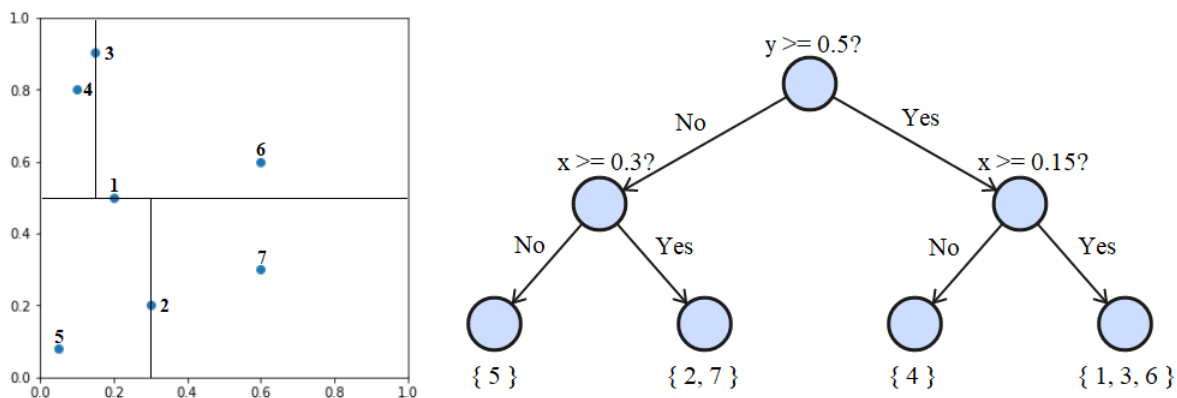


Рис. 2: Пример построенного KD-Tree,  $n_{min} = 3$

Операция запроса в KD - деревьях работает по следующему принципу: сначала устанавливается лист, соответствующей области разбиения, содержащей запрос. В этом листе находится ближайший к запросу сосед. Далее начинается восходящий по структуре дерева поиск ближайших соседей в соседних областях. А именно, если расстояние от запроса к прямоугольнику, который является другим сыном родителя листа, в котором находится запрос, меньше, чем расстояние до текущего ближайшего соседа, то алгоритм проверяет эту область на наличие ещё более близких соседей. Далее алгоритм поднимается на одну вершину вверх по дереву и выполняет те же действия. На рисунке 3 представлена иллюстрация к описанному алгоритму. Красная и синяя области – это листья в KD - дереве, черная область – их родитель, зеленые точки – исходный набор данных, черная точка - запрос. Ближайшей точкой в красной области является точка под номером 1, однако точка 3 находится ближе к запросу, поэтому алгоритм проверяет «братские» области к тем, в которых расположен запрос.

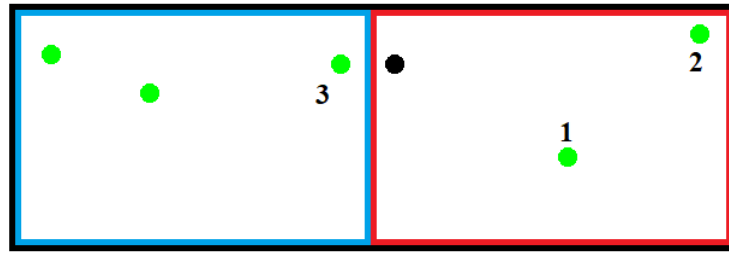


Рис. 3: Иллюстрация к операции запроса в KD - дереве

Приведем реализацию операции запроса на псевдокоде.

---

```

1: procedure MAKEQUERY(Tree, Query)
2:   todo
3: end procedure

```

---

## 3 Вычислительные эксперименты

Цель данного раздела: продемонстрировать, что предложенная теория работает на практике; показать границы её применимости; рассказать о новых экспериментальных фактах.

Чисто теоретические работы могут вообще не содержать раздела экспериментов (не работает, ну и не надо — зато теория красивая). Кстати, теоретики имеют право не догадываться, где, кому и когда их теории пригодятся.

### 3.1 Исходные данные и условия эксперимента

Описывается прикладная задача, параметры анализируемых данных (например, сколько объектов, сколько признаков, каких они типов), параметры эксперимента (например, как производился скользящий контроль).

### 3.2 Результаты эксперимента

Результаты экспериментов представляются в виде таблиц и графиков. Объясняется точный смысл всех обозначений на графиках, строк и столбцов в таблицах.

### 3.3 Обсуждение и выводы

Приводятся выводы: в какой степени результаты экспериментов согласуются с теорией? Достигнут ли желаемый результат? Обнаружены ли какие-либо факты, не нашедшие объяснения, и которые нельзя списать на «грязный» эксперимент?

Обсуждаются основные отличия предложенных методов от известных ранее. В чем их преимущества? Каковы границы их применимости? Какие проблемы удалось решить, а какие остались открытыми? Какие возникли новые постановки задач?

## 4 Заключение

В квалификационных работах последний раздел нужен для того, чтобы конспективно перечислить основные результаты, полученные лично автором.

Результатами, в частности, являются:

- Предложен новый подход к...
- Разработан новый метод..., позволяющий...
- Доказан ряд теорем, подтверждающих (опровергающих), что...
- Проведены вычислительные эксперименты..., которые подтвердили / опровергли / привели к новым постановкам задач.

Цель данного раздела: доказать квалификацию автора. Даже беглого взгляда на заключение должно быть достаточно, чтобы стало ясно: автору удалось решить актуальную, трудную, ранее не решённую задачу, предложенные автором решения обоснованы и проверены.

Иногда в Заключении приводится список направлений дальнейших исследований.

Список литературы необходим в любой научной публикации. В дипломной работе он обязателен. Дурным тоном считается: ссылаться на работы только одного-двух авторов (например, себя или шефа); ссылаться на слишком малое число работ; ссылаться только на очень старые работы; ссылаться на работы, которых автор ни разу не видел; ссылаться на работы, которые не упоминаются в тексте или которые не имеют отношения к данному тексту.