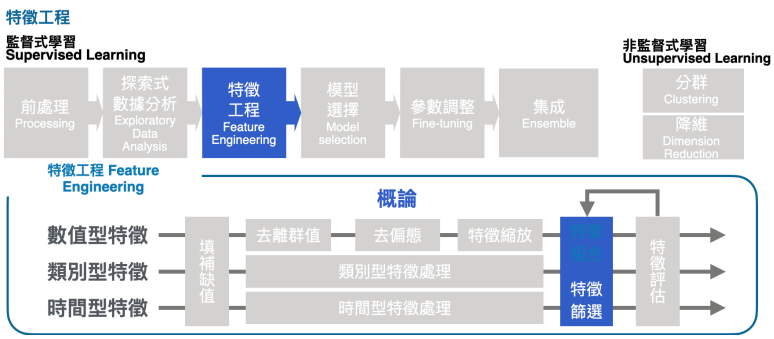
D30：特徵選擇

簡報閱讀 範例與作業 問題討論

特徵選擇

知識地圖



本日知識點目標

- 特徵選擇/篩選與特徵組合的差異是?
- 特徵選擇主要包含哪三大類方法?
- 特徵選擇中，計算時間較長，但是能排除共線性且比較穩定的方式是哪一種?

特徵選擇概念

1. 特徵需要適當的增加與減少，以提升精確度並減少計算時間

- 增加特徵 : 特徵組合 (Day 28) ，群聚編碼 (Day 29)
- 減少特徵 : 特徵選擇 (Day 30)

2. 特徵選擇有三大類方法

- **過濾法 (Filter)** : 選定統計數值與設定門檻，刪除低於門檻的特徵
- **包裝法 (Wrapper)** : 根據目標函數，逐步加入特徵或刪除特徵
- **嵌入法 (Embedded)** : 使用機器學習模型，根據擬合後的係數，刪除係數低於門檻的特徵

3.本日內容將會介紹三種較常用的特徵選擇法

- 嵌入法 : L1(Lasso)嵌入法，GDBT(梯度提升樹)嵌入法

相關係數過濾法

上圖是探索資料分析(EDA)常見的相關性熱圖 (語法詳見於今日範例)
想想看我們該如何從圖上決定，該刪除哪些特徵?

- 找到目標值 (房價預估目標為 SalePrice)之後，觀察其他特徵與目標值相關係數 (紅框處)

- 預設顏色越紅表示越正相關，越藍越負相關

- 因此要刪除紅框中顏色較淺的特徵：訂出相關係數門檻值，特徵相關係數絕對值低於門檻者刪除

Lasso(L1) 嵌入法

因為使用 Lasso Regression 時，調整不同的正規化程度，就會自然使得一部分的特徵係數為 0 ，因此刪除的是係數為 0 的特徵，不須額外指定門檻，但**需調整正規化程度**

圖源來源：sklearn網站

GDBT (梯度提升樹) 嵌入法

	計算時間	共線性	特徵穩定性
相關係數過濾法	快速	無法排除	穩定
Lasso 嵌入法	快速	能排除	不穩定
GDBT 嵌入法	較慢	能排除	穩定

特徵，這種作法也稱為 GDBT 嵌入法

- 由於特徵重要性不只可以刪除特徵，也是增加特徵的關鍵參考，因此我們會在 Day31 特別用一天為各位詳述特徵重要性

上面是提到的三種特徵選取比較，看似各有長處，但是近年來GDBT的改良版本：
Xgboost...等幾種算法，大幅改良了計算時間，因此成為了特徵選擇的主流

重要知識點複習

- 相對於特徵組合在增加特徵，特徵選擇/篩選是在**減少特徵**
- 特徵選擇主要包含：過濾法 (Filter)、包裝法 (Wrapper)與嵌入法 (Embedded)
- 特徵選擇中，計算時間較長，但是能排除共線性且比較穩定的方式是**梯度提升樹嵌入法**

延伸閱讀

若有多餘時間，可再補充延伸閱讀文章內容

推薦延伸閱讀

特徵選擇

特徵選擇
特徵選擇是特徵工程裡的一個重要問題，其目標是尋找最優特徵子集。特
zhuanlan.zhihu.com

- 特徵選擇這一知識因為在統計時代就存在，因此教學文獻就比較多了，因此我們在這邊挑選的反而是比較精簡的說明，同學可以在網頁的內容中，了解過濾法/包裝法/嵌入法三類方法更清楚的說明

- 下列是特徵選擇的基礎流程，但因為執行起來很費時，因此也需要領域知識輔助，所以關鍵還是在領域知識

特徵選擇線上手冊

machine-learning-python

undefined

machine-learning-python.kspax.io

對比上一參考資料的精簡，這一份手冊的說明就比較完整：有各式各樣的特徵選擇方式，建議同學有需要時再來查詢即可

解題時間

下一步：閱讀範例與完成作業