

TAUTOLOGY
INNOVATION
SCHOOL



MODEL EVALUATION FOR REGRESSION

BY TAUTOLOGY

MADE BY TAUTOLOGY THAILAND
DO NOT PUBLISH WITHOUT PERMISSION

facebook/tautologyai
www.tautology.live

Model Evaluation

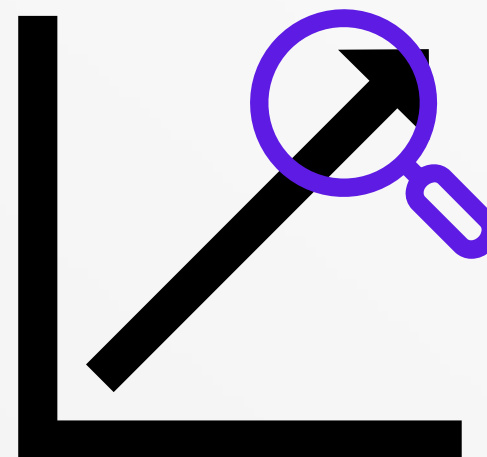
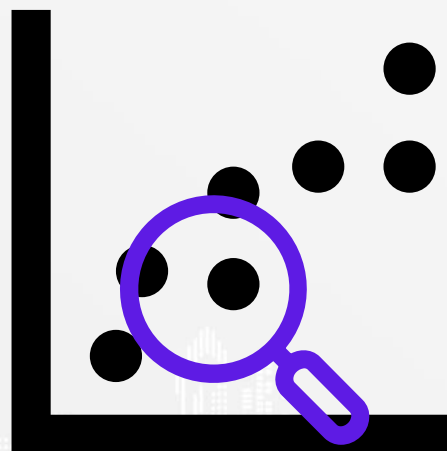
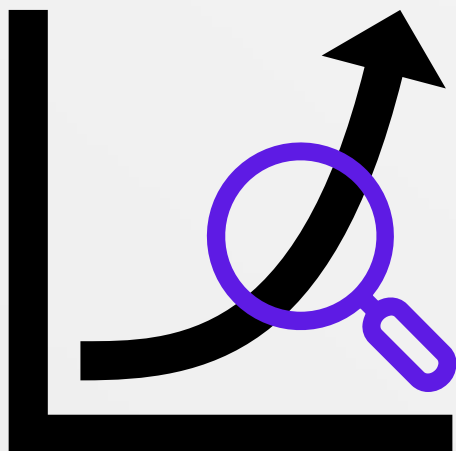
What is Model
Evaluation?

Why need Model
Evaluation?

Model Evaluation
for Regression

What is Model Evaluation?

Model Evaluation คือการวัดประสิทธิภาพของโมเดล



Model Evaluation

**What is Model
Evaluation?**



**Why need Model
Evaluation?**

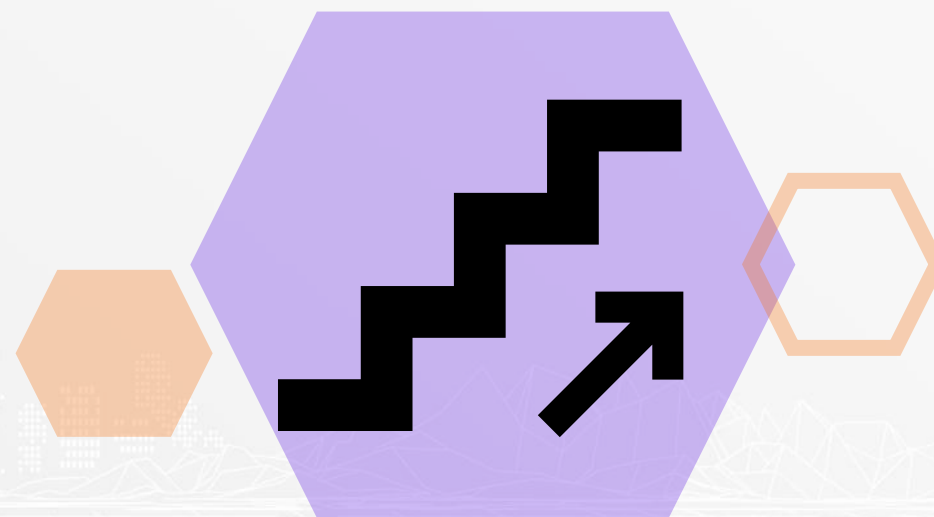


**Model Evaluation
for Regression**



Why need Model Evaluation?

- เพื่อวัดประสิทธิภาพของ model ก่อนนำไปใช้งานจริง
- เพื่อเลือก model ที่ดีที่สุด ผ่านการเปรียบเทียบประสิทธิภาพ
- เพื่อวิเคราะห์ model แล้วนำไปปรับปรุง และพัฒนาต่อ



Model Evaluation

**What is Model
Evaluation?**



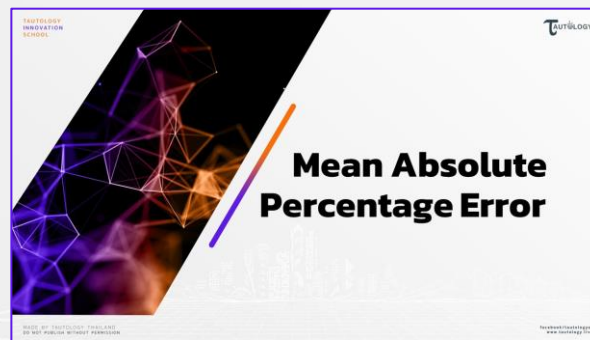
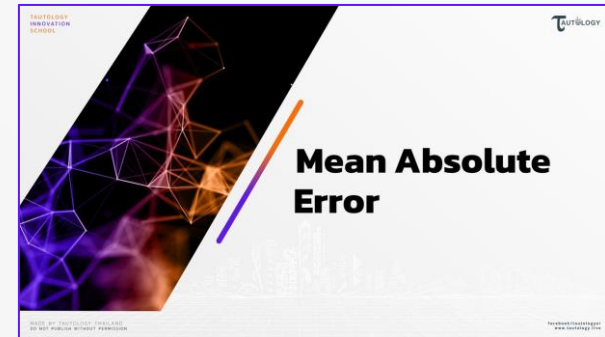
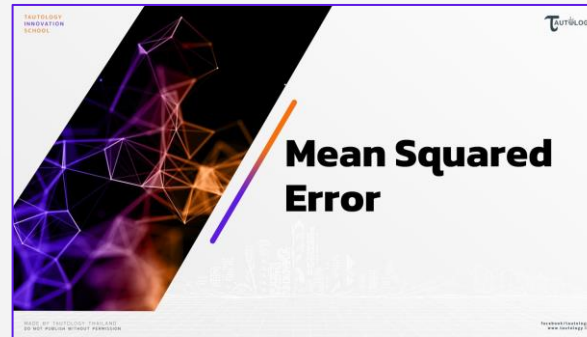
**Why need Model
Evaluation?**



**Model Evaluation
for Regression**



Model Evaluation for Regression



R^2 Score

R^2 score

- What is R^2 score?

- Formula

- Step to Calculate R^2

- Example

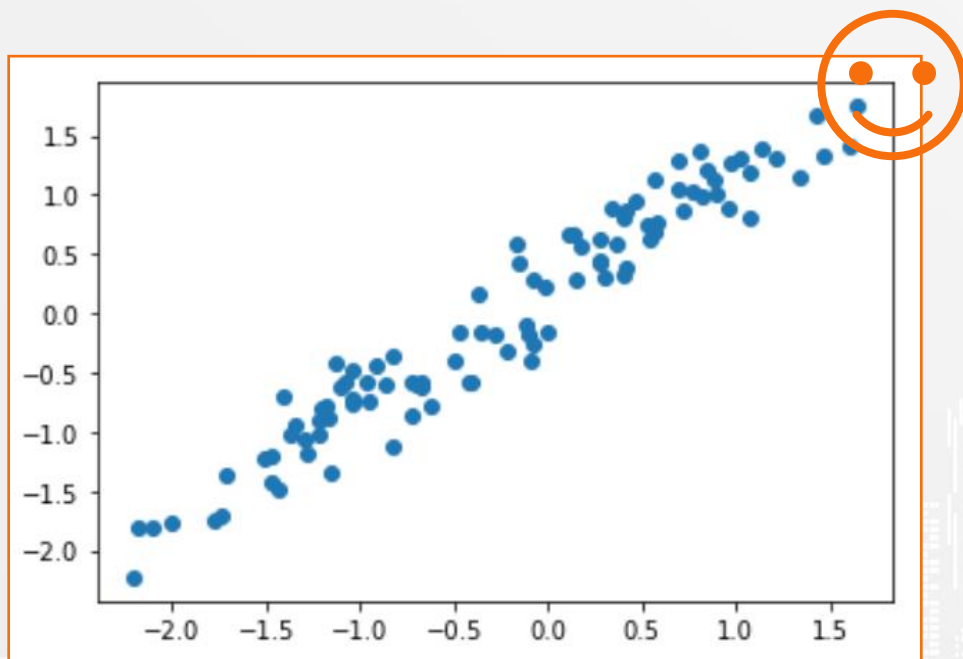
- Code

- Interpretation

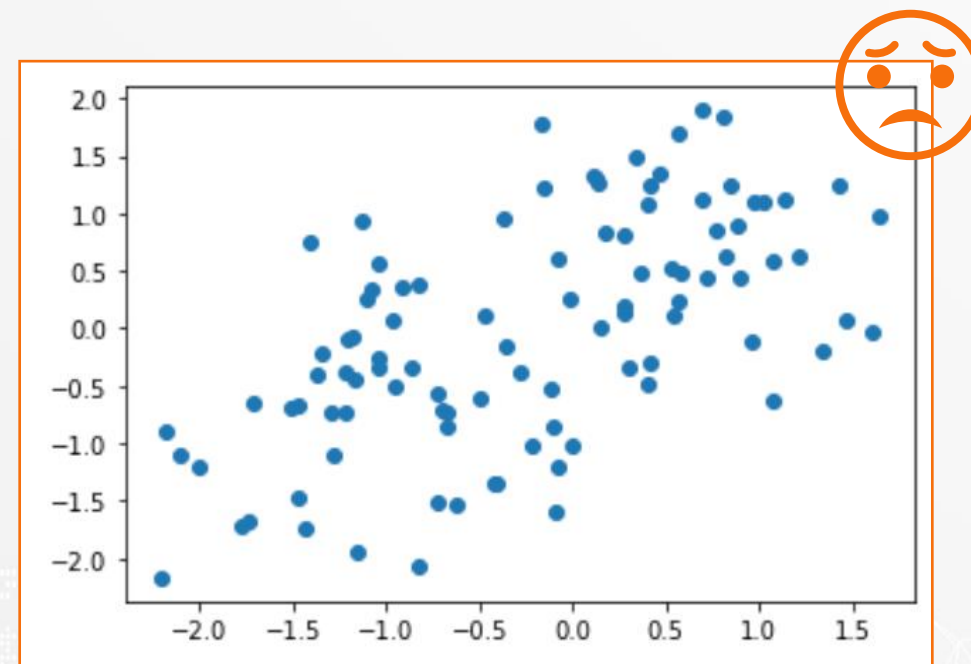
What is R^2 score?

R^2 score คือ ค่าที่บอกความสัมพันธ์ระหว่างค่าจริง และค่าพยากรณ์

Scatter Plot



Model 1



Model 2

Formula

R^2 Cost Function ?
 \hookrightarrow SSE

$$R^2 = 1 - \frac{\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2}{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2}$$

~~$\frac{1}{n} \sum (y_i - \hat{y}_i)^2$~~

- y_i คือ target ของ sample ที่ i
- \hat{y}_i คือ ค่าที่พยากรณ์ได้จากโมเดลของ sample ที่ i
- \bar{y}_i คือ ค่าเฉลี่ยของข้อมูล (target)
- $\bar{y} = \frac{\sum_{i=1}^n y_i}{n}$

Step to calculate R^2

1. เก็บค่า y_i และ \hat{y}_i
2. หาค่า \bar{y}
3. วัดประสิทธิภาพของ model ตามสูตรของ R^2

Example

1. เก็บค่า y_i และ \hat{y}_i

เป็น target ของ data อยู่แล้ว
ได้จาก model

	y	\hat{y}
0	1168	1204.183
1	1488	1498.152
2	1232	1199.06
3	949	947.087
4	439	438.018
5	262	275.159
6	897	873.342

ตารางแสดงข้อมูลของราคาบ้านจริง และราคาบ้านที่พยากรณ์ได้จากโมเดล
โดยใช้ feature ที่ใช้คือจำนวนห้องและพื้นที่ของบ้าน

Example

2. หาค่า \bar{y}

$$\begin{aligned}\bar{y} &= \frac{\sum_{i=1}^n y_i}{n} \\ \bar{y} &= \frac{1188+1468+\dots+897}{7} \\ \bar{y} &= 919.29\end{aligned}$$

Example

3. วัดประสิทธิภาพของ model ตามสูตรของ R^2

	y	\hat{y}
0	1168	1204.183
1	1488	1498.152
2	1232	1199.06
3	949	947.087
4	439	438.018
5	262	275.159
6	897	873.342

$$R^2 = 1 - \frac{\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2}{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2}$$

$$R^2 = 1 - \frac{(1168 - 1204.183)^2 + \dots + (897 - 873.342)^2}{(1168 - 919.29)^2 + \dots + (897 - 919.29)^2}$$

$$R^2 = 0.997$$

Code

	Actual_SalePrice	Predicted_SalePrice
0	1168.0	1204.18303571
1	1488.0	1498.15178571
2	1232.0	1199.06026786
3	949.0	947.08705357
4	439.0	438.01785714
5	262.0	275.15848214
6	897.0	873.34151786

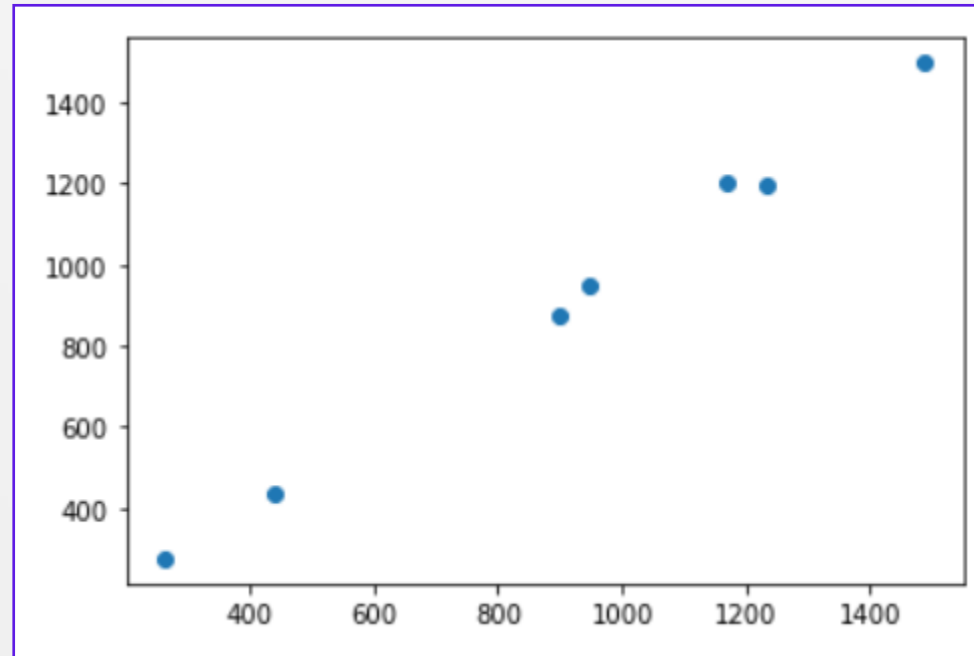
ตารางแสดงข้อมูลของราคาบ้านจริง และราคาบ้านที่พยากรณ์ได้จากโมเดล
โดยใช้ feature ที่ใช้คือจำนวนห้องและพื้นที่ของบ้าน

Code

```
1 r2_score(y_true, y_pred)
```

```
0.9971801836617127
```

Code



$$R^2 = 0.99718$$

Interpretation

ตีความตัวเลขที่ได้จากสูตร R^2 กัน
ว่ามันหมายความว่าอย่างไร

$$R^2 = 1 - \frac{\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2}{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2}$$

◆ $R^2 = 1$ ◆

↳ $\forall i, y_i = \hat{y}_i$

↳ ค่าที่ทำนาย = ค่าจริง

◆ $R^2 = 0$ ◆

↳ $\forall i, \hat{y}_i = \bar{y}$

↳ ประสิทธิภาพของ model เท่ากับ การพยากรณ์ด้วย
ค่าเฉลี่ยของ y

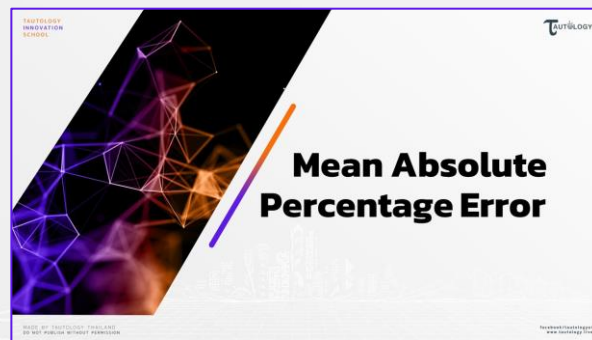
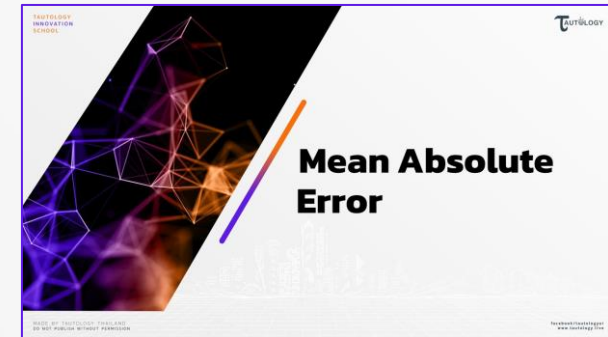
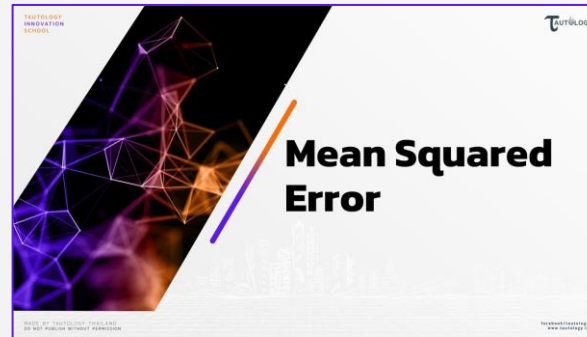
◆ $R^2 < 0$ ◆

↳ ประสิทธิภาพของ model แย่กว่า การพยากรณ์ด้วย
ค่าเฉลี่ยของ y

Interpretation

R^2 ที่ดีต้องมากกว่า 0
และยิ่งใกล้ 1 จะยิ่งดี

Model Evaluation for Regression



Mean Squared Error

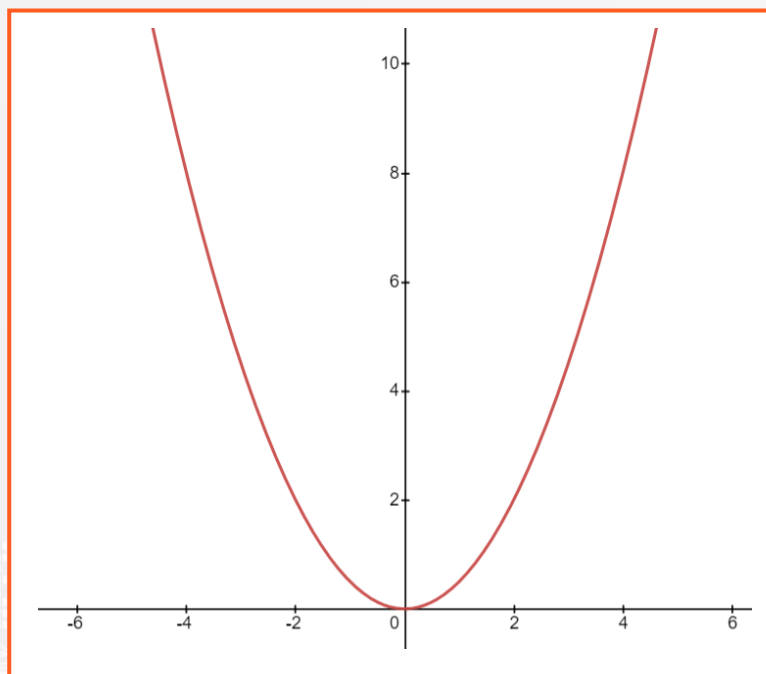
Mean Squared Error

- What is Mean Squared Error?
- Formula
- Step to Calculate MSE
- Example
- Code
- Interpretation

What is Mean Squared Error?

Mean Squared Error (MSE) คือ ค่าเฉลี่ยของ error (ผลต่างของค่าจริงและค่าพยากรณ์) ยกกำลังสอง

$$SE_i = \varepsilon_i^2$$



$$\varepsilon_i = y_i - \hat{y}_i$$

Formula

$$MSE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2$$

- y_i คือ target ของ sample ที่ i
- \hat{y}_i คือ ค่าที่พยากรณ์ได้จากโมเดลของ sample ที่ i
- n คือ จำนวน sample

Step to Calculate MSE

1. เก็บค่า y_i และ \hat{y}_i
2. วัดประสิทธิภาพของ model ตามสูตรของ mean squared error (MSE)

Example

1. เก็บค่า y_i และ \hat{y}_i

	y	\hat{y}
0	1168	1204.183
1	1488	1498.152
2	1232	1199.06
3	949	947.087
4	439	438.018
5	262	275.159
6	897	873.342

ตารางแสดงข้อมูลของราคาบ้านจริง และราคาบ้านที่พยากรณ์ได้จากโมเดล
โดยใช้ feature ที่ใช้คือจำนวนห้องและพื้นที่ของบ้าน

Example

2. วัดประสิทธิภาพของ model ตามสูตรของ mean squared error (MSE)

	y	\hat{y}
0	1168	1204.183
1	1488	1498.152
2	1232	1199.06
3	949	947.087
4	439	438.018
5	262	275.159
6	897	873.342

$$MSE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2$$

$$MSE = \frac{(1168 - 1204.183)^2 + \dots + (897 - 873.342)^2}{7}$$

$$MSE = 462.113$$

Code

	Actual_SalePrice	Predicted_SalePrice
0	1168.0	1204.18303571
1	1488.0	1498.15178571
2	1232.0	1199.06026786
3	949.0	947.08705357
4	439.0	438.01785714
5	262.0	275.15848214
6	897.0	873.34151786

ตารางแสดงข้อมูลของราคาบ้านจริง และราคาบ้านที่พยากรณ์ได้จากโมเดล
โดยใช้ feature ที่ใช้คือจำนวนห้องและพื้นที่ของบ้าน

Code

```
1 mean_squared_error(y_true, y_pred)
```

```
462.1128826530673
```

Interpretation

$$MSE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2$$

◆ $MSE = 400$ ◆

↳ ค่าเฉลี่ย $(y_i - \hat{y}_i)^2 = 400$

↳ โดยเฉลี่ยแล้ว $y_i - \hat{y}_i = \pm 20$

↳ โดยเฉลี่ยแล้ว $y_i = \hat{y}_i \pm 20$

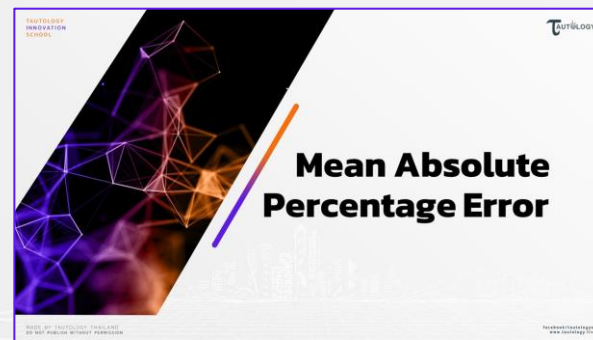
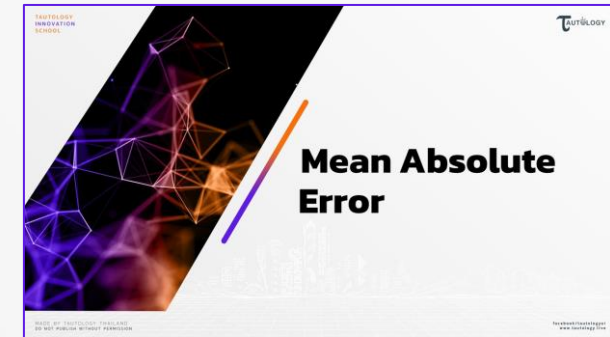
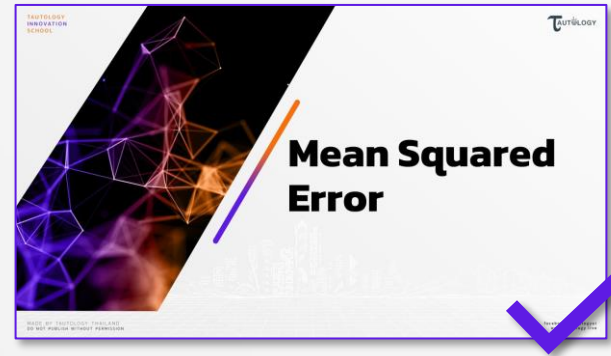
↳ ตัวอย่าง สมมติ $\hat{y}_i = 1000$

- $y_i = \hat{y}_i \pm 20 = 1000 \pm 20$
- $y_i \in [1000 - 20, 1000 + 20]$
- $y_i \in [980, 1020]$

Interpretation

$$y_i = \hat{y}_i \pm \sqrt{MSE}$$
$$y_i = [\hat{y}_i - \sqrt{MSE}, \hat{y}_i + \sqrt{MSE}]$$

Model Evaluation for Regression



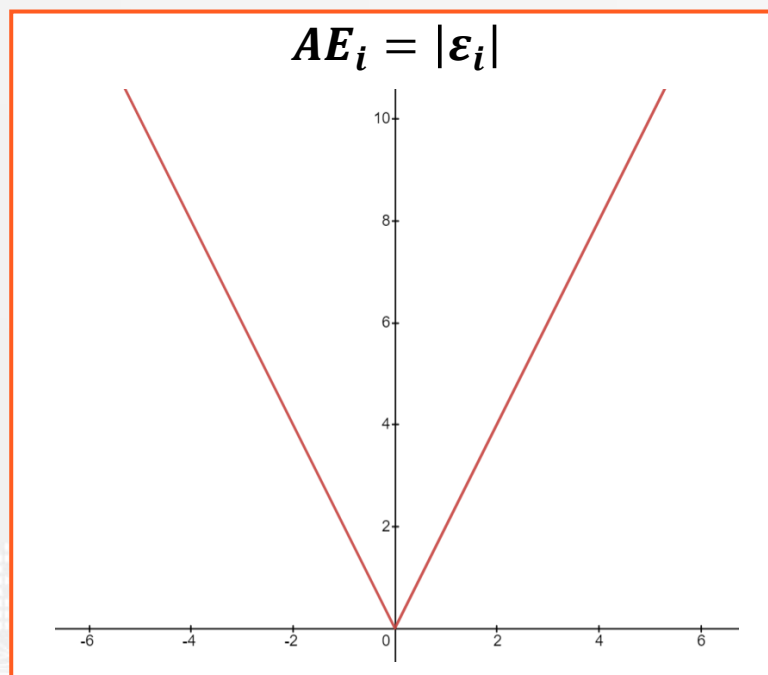
Mean Absolute Error

Mean Absolute Error

- What is Mean Absolute Error?
- Formula
- Step to Calculate MAE
- Example
- Code
- Interpretation

What is Mean Absolute Error?

Mean Absolute Error (MAE) คือ ค่าเฉลี่ยของ absolute ของ error (ผลต่างของค่าจริงและค่าพยากรณ์)



$$\epsilon_i = y_i - \hat{y}_i$$

Formula

$$MAE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n |y_i - \hat{y}_i|$$

- y_i คือ target ของ sample ที่ i
- \hat{y}_i คือ ค่าที่พยากรณ์ได้จากโมเดลของ sample ที่ i
- n คือ จำนวน sample

Step to Calculate MAE

1. เก็บค่า y_i และ \hat{y}_i
2. วัดประสิทธิภาพของ model ตามสูตรของ mean absolute error (MAE)

Example

1. เก็บค่า y_i และ \hat{y}_i

	y	\hat{y}
0	1168	1204.183
1	1488	1498.152
2	1232	1199.06
3	949	947.087
4	439	438.018
5	262	275.159
6	897	873.342

ตารางแสดงข้อมูลของราคาบ้านจริง และราคาบ้านที่พยากรณ์ได้จากโมเดล
โดยใช้ feature ที่ใช้คือจำนวนห้องและพื้นที่ของบ้าน

Example

2. วัดประสิทธิภาพของ model ตามสูตรของ mean absolute error (MAE)

	y	\hat{y}
0	1168	1204.183
1	1488	1498.152
2	1232	1199.06
3	949	947.087
4	439	438.018
5	262	275.159
6	897	873.342

$$MAE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n |y_i - \hat{y}_i|$$

$$MAE = \frac{1}{7} \{|1168 - 1204.183| + \dots + |897 - 873.342|\}$$

$$MAE = 16.998$$

Code

	Actual_SalePrice	Predicted_SalePrice
0	1168.0	1204.18303571
1	1488.0	1498.15178571
2	1232.0	1199.06026786
3	949.0	947.08705357
4	439.0	438.01785714
5	262.0	275.15848214
6	897.0	873.34151786

ตารางแสดงข้อมูลของราคาบ้านจริง และราคาบ้านที่พยากรณ์ได้จากโมเดล
โดยใช้ feature ที่ใช้คือจำนวนห้องและพื้นที่ของบ้าน

Code

```
1 mean_absolute_error(y_true, y_pred)
```

```
16.998086734694034
```

Interpretation

$$MAE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n |y_i - \hat{y}_i|$$

◆ $MAE = 17$ ◆

↳ ค่าเฉลี่ย $|y_i - \hat{y}_i| = 17$

↳ โดยเฉลี่ยแล้ว $y_i - \hat{y}_i = \pm 17$

↳ โดยเฉลี่ยแล้ว $y_i = \hat{y}_i \pm 17$

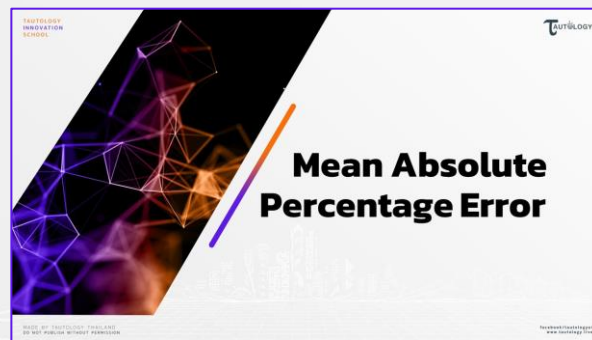
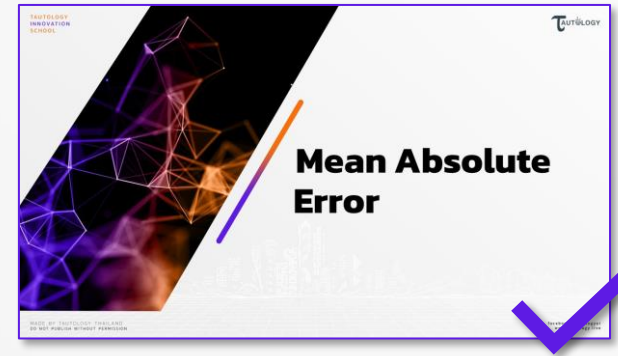
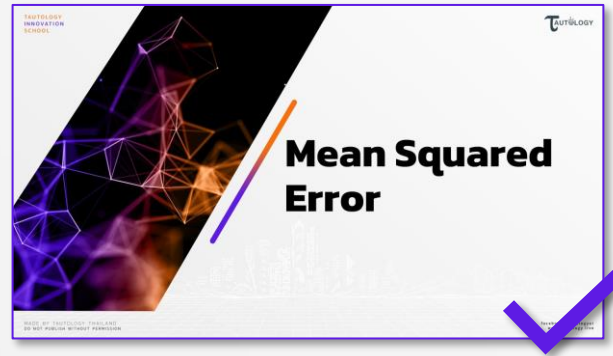
↳ ตัวอย่าง สมมติ $\hat{y}_i = 1000$

- $y_i = \hat{y}_i \pm 17 = 1000 \pm 17$
- $y_i \in [1000 - 17, 1000 + 17]$
- $y_i \in [983, 1017]$

Interpretation

$$y_i = \hat{y}_i \pm MAE$$
$$y_i \in [\hat{y}_i - MAE, \hat{y}_i + MAE]$$

Model Evaluation for Regression



Mean Absolute Percentage Error

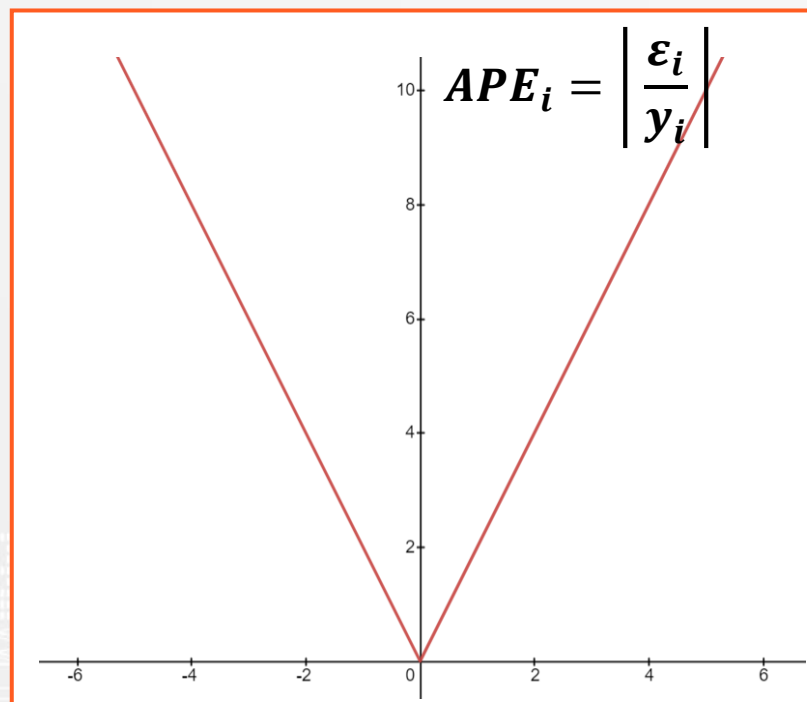
Mean Absolute Percentage Error

- What is Mean Absolute Percentage Error?
- Formula
- Step to Calculate MAPE
- Example
- Code
- Interpretation

What is Mean Absolute Percentage Error?

Mean Absolute Percentage Error (MAPE) คือ ค่าเฉลี่ยของ absolute ของ อัตราส่วนระหว่าง error (ผลต่างของค่าจริงและค่าพยากรณ์) และข้อมูลจริง

error
↓
หาค่าสัมบูรณ์
↓
absolute
↓
รวมทุก sample แล้วนำค่าเฉลี่ย



$$\epsilon_i = y_i - \hat{y}_i$$

Formula

$$MAPE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \left| \frac{y_i - \hat{y}_i}{y_i} \right|$$

- y_i คือ target ของ sample ที่ i
- \hat{y}_i คือ ค่าที่พยากรณ์ได้จากโมเดลของ sample ที่ i
- n คือ จำนวน sample

Step to Calculate MAPE

1. เก็บค่า y_i และ \hat{y}_i
2. วัดประสิทธิภาพของ model ตามสูตรของ mean absolute percentage error (*MAPE*)

Example

1. เก็บค่า y_i และ \hat{y}_i

	y	\hat{y}
0	1168	1204.183
1	1488	1498.152
2	1232	1199.06
3	949	947.087
4	439	438.018
5	262	275.159
6	897	873.342

ตารางแสดงข้อมูลของราคาบ้านจริง และราคาบ้านที่พยากรณ์ได้จากโมเดล
โดยใช้ feature ที่ใช้คือจำนวนห้องและพื้นที่ของบ้าน

Example

2. วัดประสิทธิภาพของ model ตามสูตรของ mean absolute percentage error (*MAPE*)

	y	\hat{y}
0	1168	1204.183
1	1488	1498.152
2	1232	1199.06
3	949	947.087
4	439	438.018
5	262	275.159
6	897	873.342

$$MAPE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \left| \frac{y_i - \hat{y}_i}{y_i} \right|$$

$$MAPE = \frac{1}{7} \left\{ \left| \frac{1168 - 1204.183}{1168} \right| + \dots + \left| \frac{897 - 873.342}{897} \right| \right\}$$

$$MAPE = 0.021$$

Code

	Actual_SalePrice	Predicted_SalePrice
0	1168.0	1204.18303571
1	1488.0	1498.15178571
2	1232.0	1199.06026786
3	949.0	947.08705357
4	439.0	438.01785714
5	262.0	275.15848214
6	897.0	873.34151786

ตารางแสดงข้อมูลของราคาบ้านจริง และราคาบ้านที่พยากรณ์ได้จากโมเดล
โดยใช้ feature ที่ใช้คือจำนวนห้องและพื้นที่ของบ้าน

Code

```
1 mean_absolute_percentage_error(y_true, y_pred)
```

```
0.02076988136170835
```

Interpretation

$$MAPE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \left| \frac{y_i - \hat{y}_i}{y_i} \right|$$

◆ $MAPE = 0.021$ ◆

↳ $MAPE = 0.021 \times 100 = 2.1\%$

↳ โดยเฉลี่ยแล้ว \hat{y}_i จะคลาดเคลื่อนอยู่ $\pm 2.1\%$

↳ ตัวอย่าง สมมติ $\hat{y}_i = 1000$

- $y_i = \hat{y}_i \pm 2.1\% = 1000 \pm 2.1\%$
- $y_i \in [1000 - 2.1\%, 1000 + 2.1\%]$
- $y_i \in [979, 1021]$

Interpretation

$$y_i = \hat{y}_i \pm MAPE \times 100\%$$
$$y_i \in [\hat{y}_i - MAPE(\%), \hat{y}_i + MAPE(\%)]$$

Interpretation

★ ข้อควรระวัง ★

$$y = [0.0001, 4, 11, 6, 8]$$

$$\hat{y} = [1, 7, 8, 5, 4]$$

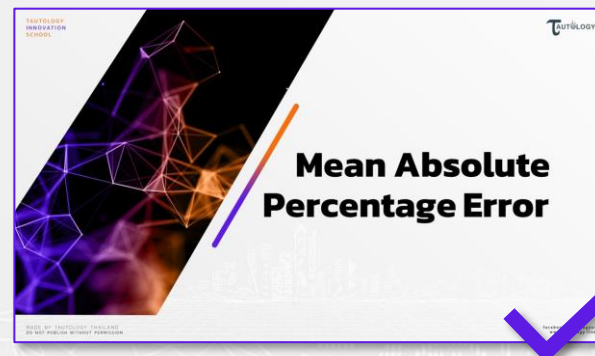
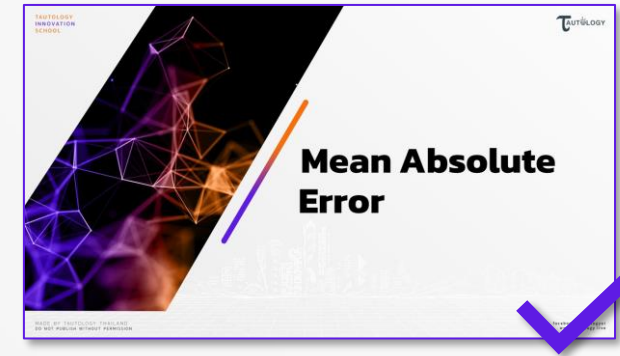
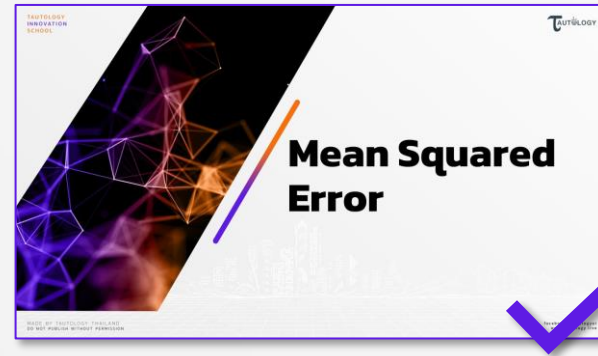
$$\begin{aligned} MAPE &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \left| \frac{y_i - \hat{y}_i}{y_i} \right| \\ &= \frac{1}{5} \left(\left| \frac{0.0001 - 1}{0.0001} \right| + \left| \frac{4 - 7}{4} \right| + \left| \frac{11 - 8}{11} \right| + \left| \frac{6 - 5}{6} \right| + \left| \frac{8 - 4}{8} \right| \right) \\ &= \frac{1}{5} (9999 + 0.75 + 0.2727 + 0.1667 + 0.5) \\ &= 2000.1379 = 200013.79\% \end{aligned}$$

Interpretation

✱ ข้อควรระวัง ✱

สำหรับการใช้ *MAPE* ควรระวังว่า
“ค่า y_i ไม่ควรใกล้เคียง 0”

Model Evaluation for Regression



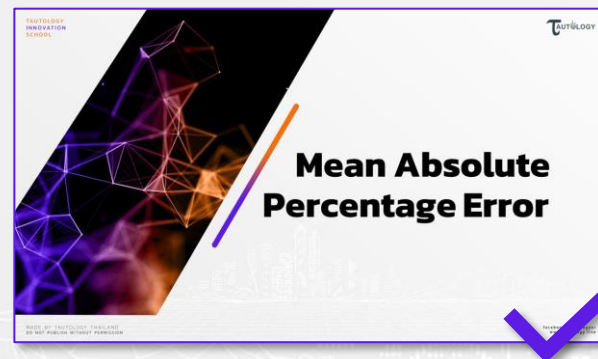
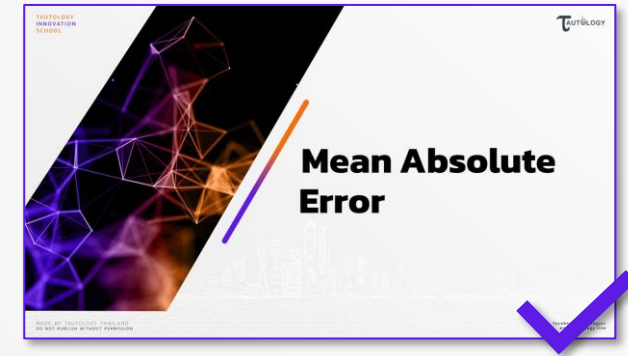
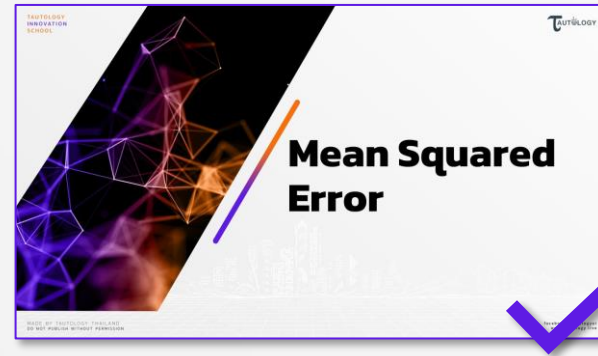
Conclusion

งาน regression ประเภทไหนก็ตามใช้ 4 ตัวนี้ได้

Conclusion

Name	Formula	How to use
R^2	$R^2 = 1 - \frac{\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2}{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2}$	ใช้บอกประสิทธิภาพของ model เมื่อเทียบกับการพยากรณ์ด้วยค่าเฉลี่ยของ y
MSE	$MSE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2$	ใช้ในบริบทของ Cost function ใช้เปรียบเทียบในหลายๆ model
MAE	$MAE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i - \hat{y}_i $	ใช้บอกระยะความคลาดเคลื่อนของการพยากรณ์
$MAPE$	$MAPE = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \left \frac{y_i - \hat{y}_i}{y_i} \right $	ใช้บอกความคลาดเคลื่อนของการพยากรณ์ในหน่วย %

Model Evaluation for Regression



Model Evaluation

**What is Model
Evaluation?**



**Why need Model
Evaluation?**



**Model Evaluation
for Regression**

