

Regressione Non Lineare

Analisi Predittiva di Variabili Continue

Programmazione di Applicazioni Data Intensive

Laurea in Ingegneria e Scienze Informatiche
DISI – Università di Bologna, Cesena

Proff. Gianluca Moro, Roberto Pasolini
nome.cognome@unibo.it



Regressione Polinomiale

- La *regressione polinomiale* è una generalizzazione di quella lineare con altri **termini di grado superiore**
 - per ottenere modelli capaci di descrivere data set più complessi
 - altre funzioni non lineari: e.g. *Gaussian Radial Basis Function*
- Ad esempio, con una sola variabile indipendente, un modello polinomiale di grado 3 ha 4 termini con altrettanti parametri

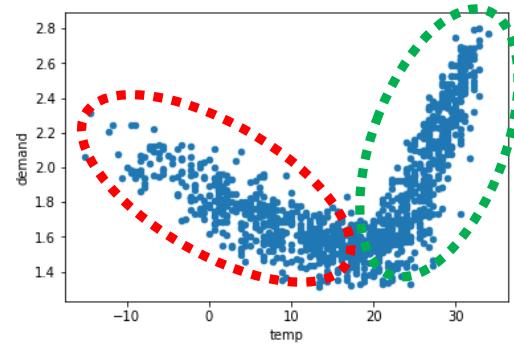
$$h(x) = \theta_0 + \theta_1 \cdot x + \theta_2 \cdot x^2 + \theta_3 \cdot x^3$$
 dove x è sempre il dato di input
- Su 2 variabili a e b un modello di grado 2 ha invece 6 termini

$$h(a, b) = \theta_0 + \theta_1 \cdot a + \theta_2 \cdot a^2 + \theta_3 \cdot b + \theta_4 \cdot a \cdot b + \theta_5 \cdot b^2$$
- la regressione polinomiale è **ancora lineare, rispetto ai parametri θ** , non nelle variabili dei dati a, b che però sono noti
 - la funzione d'errore è definita in uno spazio a maggiori dimensioni θ
 - l'algoritmo di regressione rimane il medesimo di quella lineare



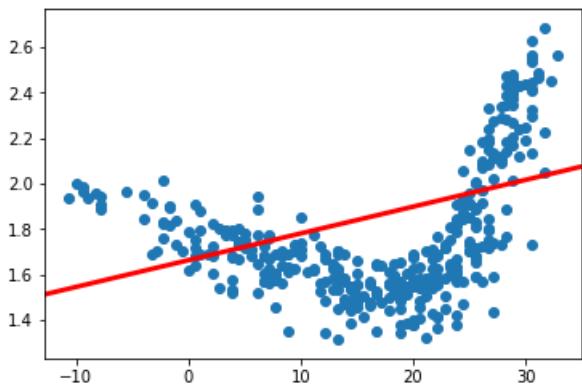
Esempio: Predizione del Consumo di Elettricità sull'Intero Anno

- Abbiamo visto come esempio la **predizione dei consumi nei mesi estivi**, durante i quali si usa aria condizionata
- Ci si aspetta però un aumento dei consumi anche nei mesi più freddi, per via dell'uso di sistemi di riscaldamento elettrici
- Visualizzando i dati di tutto l'anno in un grafico a dispersione, si nota un **aumento dei consumi anche con temperature basse**
- Possiamo addestrare un **modello di regressione unico** che permetta di effettuare predizioni sui consumi per tutto l'anno ?



Esempio: Predizione Consumi su tutto l'anno con Regressione Lineare

- Addestrando un **modello lineare** su questi dati, l'approssimazione è **inaccurata**
 - l'err. quadratrico medio sui dati di validazione è 0,081
 - l'errore relativo è del 14,4%
 - il coefficiente R^2 è 0,028
- Come si vede dal grafico, i dati non sono approssimabili in modo soddisfacente con una retta
- Possiamo ottenere un'approssimazione migliore con un modello polinomiale ?



Esempio: Predizione Consumi su tutto l'anno con Regressione Polinomiale di 2° grado (i)

- Con un modello polinomiale di secondo grado, la formula che stima il consumo y dalla temperatura x diventa:

$$\hat{y} = \theta_0 + \theta_1 \cdot x + \theta_2 \cdot x^2$$

- L'errore quadratico medio è quindi:

$$E(\theta) = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m (\theta_0 + \theta_1 \cdot x_i + \theta_2 \cdot x_i^2 - y_i)^2$$

- Ad esempio, con le 3 osservazioni viste in precedenza la funzione di errore da minimizzare è

$$\begin{aligned} E(\theta) &= \frac{1}{3} \left((\theta_0 + \theta_1 \cdot x_1 + \theta_2 \cdot x_1^2 - y_1)^2 + (\theta_0 + \theta_1 \cdot x_2 + \theta_2 \cdot x_2^2 - y_2)^2 + (\theta_0 + \theta_1 \cdot x_3 + \theta_2 \cdot x_3^2 - y_3)^2 \right) \\ &= \frac{1}{3} \left((\theta_0 + 25.2\theta_1 + 635.04\theta_2 - 2.13)^2 + (\theta_0 + 27.1\theta_1 + 734.41\theta_2 - 2.21)^2 + (\theta_0 + 26.9\theta_1 + 723.6\theta_2 - 2.22)^2 \right) \end{aligned}$$

- calcoliamo il vettore gradiente di $\theta_0, \theta_1, \theta_2$

data	temp. media	picco consumo
01/06/2016	$x_1 = 25,2^\circ\text{C}$	$y_1 = 2,13 \text{ GW}$
02/06/2016	$x_2 = 27,1^\circ\text{C}$	$y_2 = 2,21 \text{ GW}$
03/06/2016	$x_3 = 26,9^\circ\text{C}$	$y_3 = 2,22 \text{ GW}$



Esempio: Predizione Consumi su tutto l'anno con Regressione Polinomiale di 2° grado (ii)

- Per calcolare il vettore gradiente, calcoliamo le derivate parziali di $E(\theta)$

$$E(\theta) = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m (\theta_0 + \theta_1 \cdot x_i + \theta_2 \cdot x_i^2 - y_i)^2$$

$$\frac{\partial E(\theta)}{\theta_0} = \frac{2}{m} \sum_{i=1}^m (\theta_0 + \theta_1 \cdot x_i + \theta_2 \cdot x_i^2 - y_i)$$

$$\frac{\partial E(\theta)}{\theta_1} = \frac{2}{m} \sum_{i=1}^m (\theta_0 + \theta_1 \cdot x_i + \theta_2 \cdot x_i^2 - y_i) \cdot x_i$$

$$\frac{\partial E(\theta)}{\theta_2} = \frac{2}{m} \sum_{i=1}^m (\theta_0 + \theta_1 \cdot x_i + \theta_2 \cdot x_i^2 - y_i)^2 \cdot x_i^2$$



Esempio: Predizione Consumi su tutto l'anno con Regressione Polinomiale di 2° grado (iii)

- funzione d'errore da minimizzare

$$E(\boldsymbol{\theta}) = \frac{1}{3} \left((\theta_0 + 25.2\theta_1 + 635.04\theta_2 - 2.13)^2 + (\theta_0 + 27.1\theta_1 + 734.41\theta_2 - 2.21)^2 + (\theta_0 + 26.9\theta_1 + 723.6\theta_2 - 2.22)^2 \right)$$

- sostituiamo i dati noti x e y nelle derivate e otteniamo

$$\frac{\partial E(\boldsymbol{\theta})}{\partial \theta_0} = -4.37 + 2\theta_0 + 52.8\theta_1 + 1395.37\theta_2$$

$$\frac{\partial E(\boldsymbol{\theta})}{\partial \theta_1} = -115.52 + 52.8\theta_0 + 1395.37\theta_1 + 36913.6\theta_2$$

$$\frac{\partial E(\boldsymbol{\theta})}{\partial \theta_2} = -3054.72 + 1395.37\theta_0 + 36913.6\theta_1 + 977487\theta_2$$

- quindi il gradiente (l'apice k è lo step k -esimo di discesa per $\theta_0, \theta_1, \theta_2$)

$$\theta_0^{k+1} = \theta_0^k - \eta(-4.37 + 2\theta_0^k + 52.8\theta_1^k + 1395.37\theta_2^k)$$

$$\theta_1^{k+1} = \theta_1^k - \eta(-115.52 + 52.8\theta_0^k + 1395.37\theta_1^k + 36913.6\theta_2^k)$$

$$\theta_2^{k+1} = \theta_2^k - \eta(-3054.72 + 1395.37\theta_0^k + 36913.6\theta_1^k + 977487\theta_2^k)$$

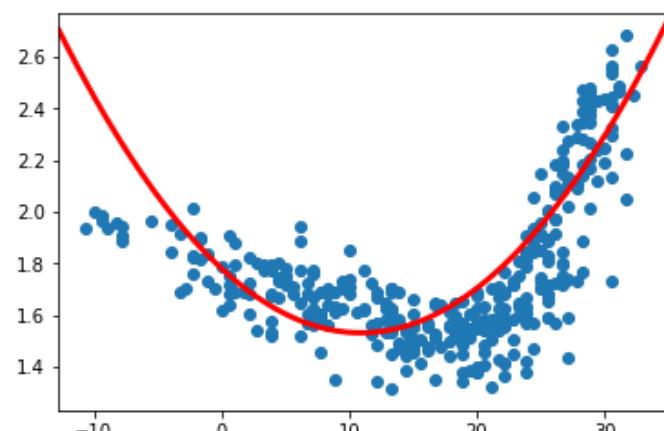
Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

7



Esempio: Risultato della Predizione Consumi su tutto l'anno con Regressione Polinomiale di 2° grado

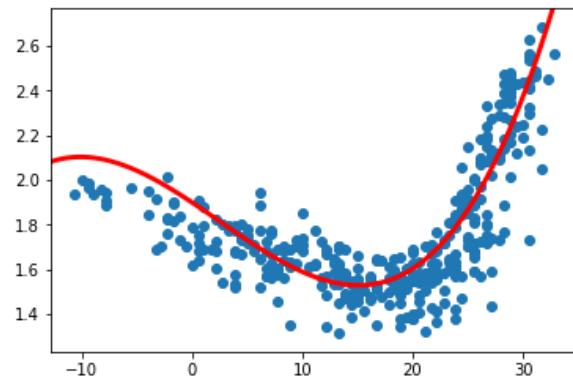
- Il modello di secondo grado corrisponde ad una parabola, che visivamente approssima in modo migliore i dati
- Questo emerge anche misurando l'errore
 - l'errore quadratico medio sul validation set è 0,036
 - l'errore relativo è 8,8%
 - il coefficiente R^2 è 0,566
- Possiamo fare meglio ?



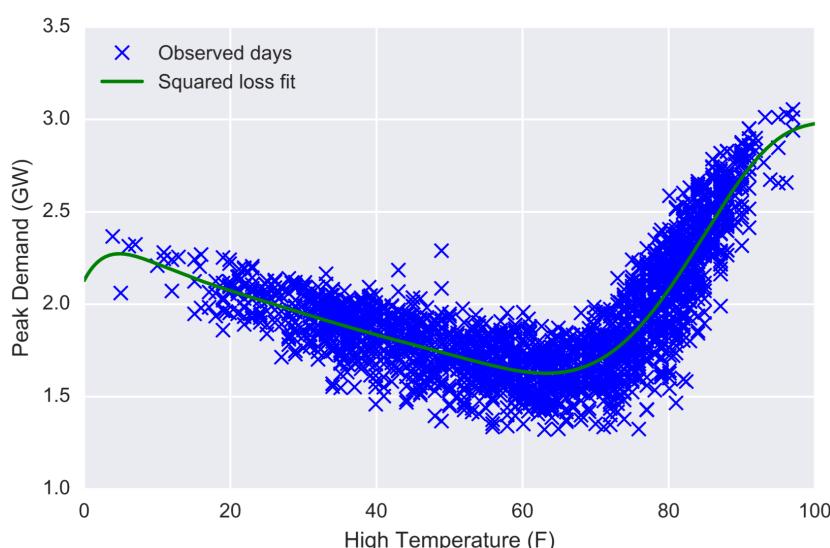
Esempio: Predizione Consumi su tutto l'anno con Regressione Polinomiale di 3° grado

- Cosa succede con un modello di 3° grado ? → 4 variabili θ

$$\hat{y} = \theta_0 + \theta_1 \cdot x + \theta_2 \cdot x^2 + \theta_3 \cdot x^3$$
- La forma del modello è quella di una curva cubica, che visivamente sembra approssimare ancora meglio i dati
- Infatti misurando l'errore...
 - l'errore quadratico medio sul validation set è 0,025
 - l'errore relativo è **6,9%**
 - il coefficiente R^2 è 0,703



Esempio: Predizione Consumi su tutto l'anno con Regressione Polinomiale di grado 10



- aumentando il grado fino a 10 si ottiene ancora un miglioramento



scikit-learn: Pre-processing

- scikit-learn offre diverse classi per pre-elaborare i dati, con la possibilità di cambiare l'insieme delle feature
 - queste offrono una API comune, simile agli algoritmi di learning
- Per usare una classe di pre-processing, questa va dapprima creata indicando eventuali parametri
- Creato l'oggetto che definisce la trasformazione da applicare, ne usiamo i metodi per applicarla su insiemi di dati
 - alla prima applicazione va usato il metodo `fit_transform` per far sì che l'oggetto apprenda la struttura dei dati
 - in genere, come per i modelli, il *fit* è eseguito sui soli dati di training
 - alle successive applicazioni si usa il metodo `transform`, che presume che i dati abbiano la stessa struttura (cioè le stesse variabili)



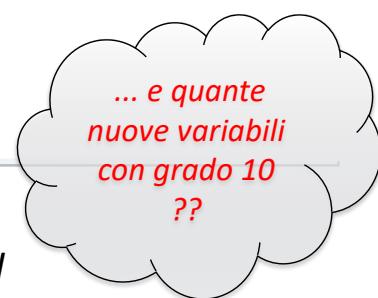
scikit-learn: Aggiunta di Feature Polinomiali

- La classe `PolynomialFeatures` aggiunge alle variabili di grado 1 tutte quelle fino al grado N

```
from sklearn.preprocessing import PolynomialFeatures
poly = PolynomialFeatures(degree=2)
```

- Ad esempio la trasformata di questa matrice con 2 variabili (colonne) e 2 osservazioni è...

```
poly.fit_transform([[2, 10], [-3, 20]])
array([[ 1.,  2.,  10.,  4.,  20., 100.],
       [ 1.,  3.,  20.,  9.,  60., 400.]])
```



<i>a</i>	<i>b</i>
2	10
-3	20



- Per escludere il termine di grado 0

(ridondante con l'intercetta) va indicato

`include_bias=False` nel costruttore

```
poly = PolynomialFeatures(degree=2, include_bias=False)
```

1	<i>a</i>	<i>b</i>	a^2	$a \cdot b$	b^2
1	2	10	4	20	100
1	-3	20	9	-60	400



scikit-learn: Regressione Polinomiale

- Per eseguire la regressione polinomiale in scikit-learn possiamo quindi creare un filtro per l'aggiunta delle feature...


```
poly = PolynomialFeatures(degree=2, include_bias=False)
```
- ...e usare ancora un modello `LinearRegression`, ma stavolta convertendo i dati in input

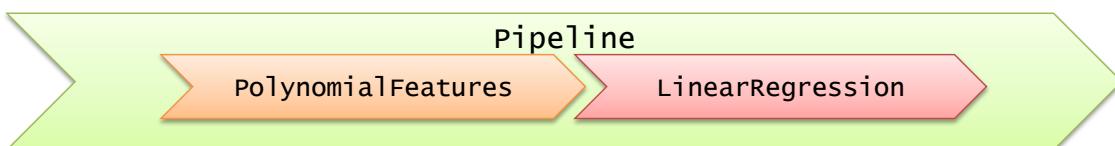

```
prm = LinearRegression()
prm.fit(poly.fit_transform(x_train), y_train)
```
- Per utilizzare il modello, i dati vanno trasformati utilizzando lo stesso filtro


```
>>> prm.predict(poly.transform(30))
array([2.2923595])
>>> prm.score(poly.transform(x_val), y_val)
```



scikit-learn: Pipeline

- Nella pratica è spesso necessario addestrare ed utilizzare un modello applicando trasformazioni a tutti dati in input
 - si può avere una sequenza più o meno lunga di trasformazioni
- Una *pipeline* incapsula una o più trasformazioni e un modello, permettendo di interagire con essi come un'entità unica
 - l'API dell'oggetto pipeline è la stessa di un modello "semplice", con i metodi `fit`, `predict`, `score`, ... che funzionano allo stesso modo
 - ad ogni chiamata di questi metodi, le trasformazioni sono applicate automaticamente ai dati in input prima di essere passate al modello
- Ad es. un modello di regressione polinomiale si può costruire abbinandone a uno lineare un filtro `PolynomialFeatures`



scikit-learn: Definizione ed Uso di una Pipeline

- Per costruire una pipeline forniamo una lista degli elementi che la compongono, con un nome associato a ciascuna

```
from sklearn.pipeline import Pipeline
prm = Pipeline([
    # nome     elemento
    ("poly",
        PolynomialFeatures(degree=2, include_bias=False)),
    ("linreg", LinearRegression())
])
```

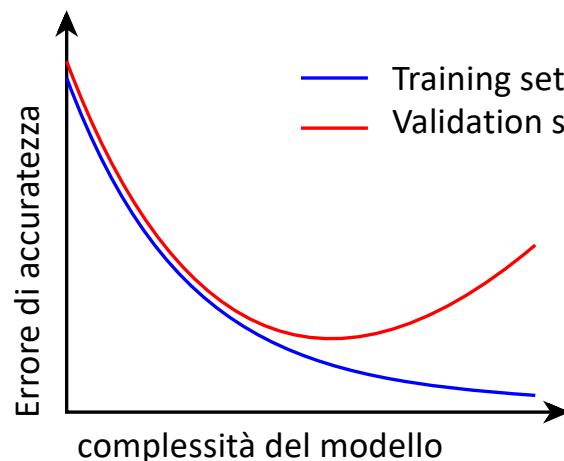
- Una volta creata, la pipeline può essere utilizzata come un modello singolo, con i filtri applicati in automatico

```
>>> prm.fit(x_train, y_train)
>>> prm.predict(30)
>>> prm.score(x_val, y_val)
```

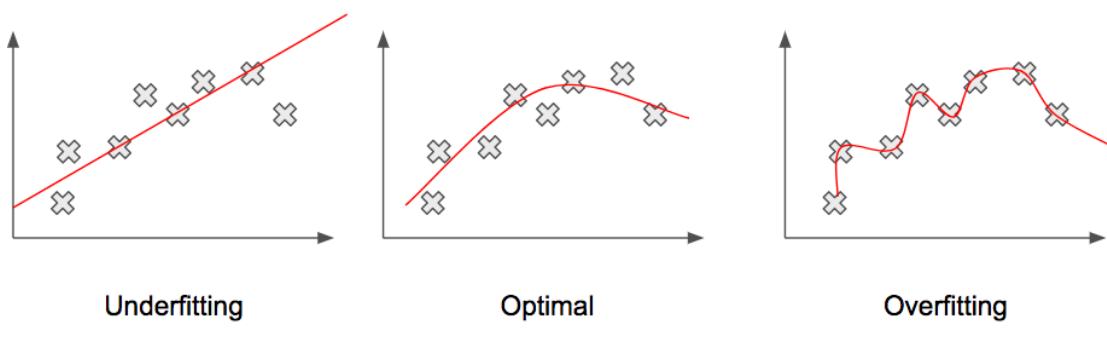


Complessità del Modello: *Overfitting Vs Generalizzazione*

- i dati devono essere divisi in training set e validation set
- qualsiasi modello di learning si estraе dal training set
- all'aumentare della complessità del modello di learning si riduce l'errore
- ma dopo una certa soglia di complessità, l'errore sul validation set torna a crescere
- questa è la soglia di overfitting che indica che la maggior complessità dei modelli descrive meglio il training set ma non il validation set
 - il modello ha perso di generalità
- scegliamo il modello che minimizzi l'errore sul validation set



Complessità del Modello: Underfitting ed Overfitting

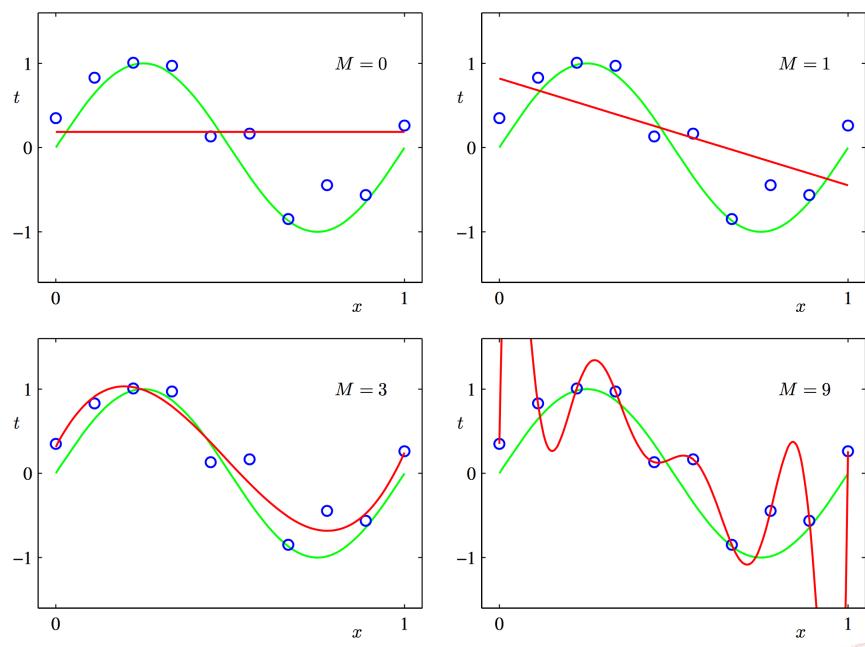


- **Underfitting**
 - il modello è troppo semplice e quindi inadeguato a rappresentare i dati, è insoddisfacente sia l'errore sul training, sia sul validation
- **Overfitting**
 - il modello è troppo complesso, l'errore sul training è significativamente inferiore a quello sul validation, il modello non generalizza dal training e non rappresenta adeguatamente dati ignoti
- **Modello ottimale: minimizza l'errore sul validation set**

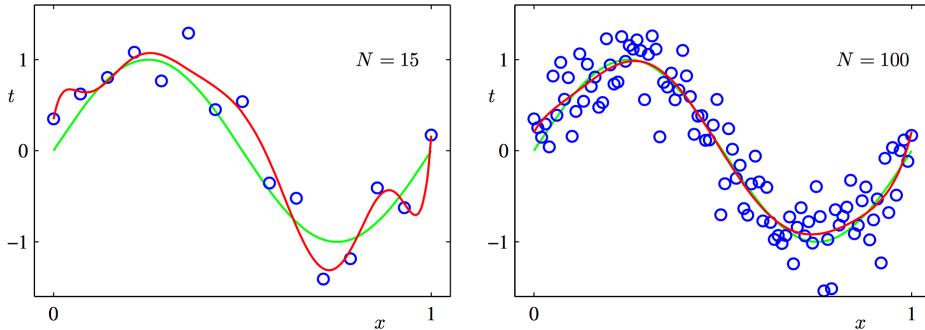


Complessità del Modello: Underfitting ed Overfitting in base al Grado del Polinomio

- in blu i dati
- in verde la regressione ideale
- in rosso la regressione all'aumentare del grado M
- Underfitting con $M < 3$
- Overfitting con $M \geq 9$



Complessità del Modello e Quantità dei Dati



- Nella figura di sinistra, con polinomio di grado 9 e $N=15$ dati, il modello (curva rossa) è in overfitting
 - differenza significativa con la curva verde ottimale
- Con $N=100$ e stesso grado si ottiene un modello ottimale
 - quantità di dati e complessità del modello sono interdipendenti
 - con pochi dati la regressione può migliorare aggiungendo dati casuali generati tenendo conto della distribuzione di quelli reali

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

19



Training, Validation Set e Parametri e Iperparametri

Training set (e.g. 70%)

Holdout / validation set (e.g. 30%)

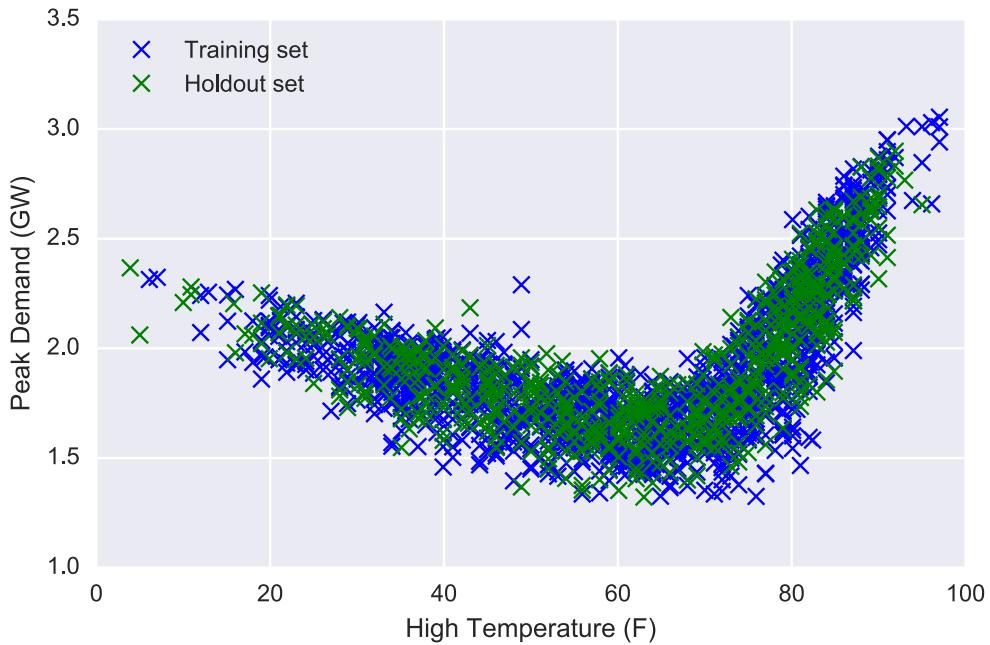
- suddividiamo i dati in training e validation set (holdout)
 - di norma la suddivisione è casuale; esistono metodi più complessi
- suddivisioni classiche 70-30, 2/3-1/3, ma anche 50-50
- Dal training set si determinano i parametri θ del modello di learning, e.g. i coefficienti α e β nella regressione
- Gli iperparametri sono tutte le altre scelte e si determinano dal validation set:
 - Il tipo di funzione di regressione, lineare o polinomiale, il grado, la normalizzazione, regolarizzazione, il learning rate etc.

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

20



Esempio di Holdout: Training e Validation



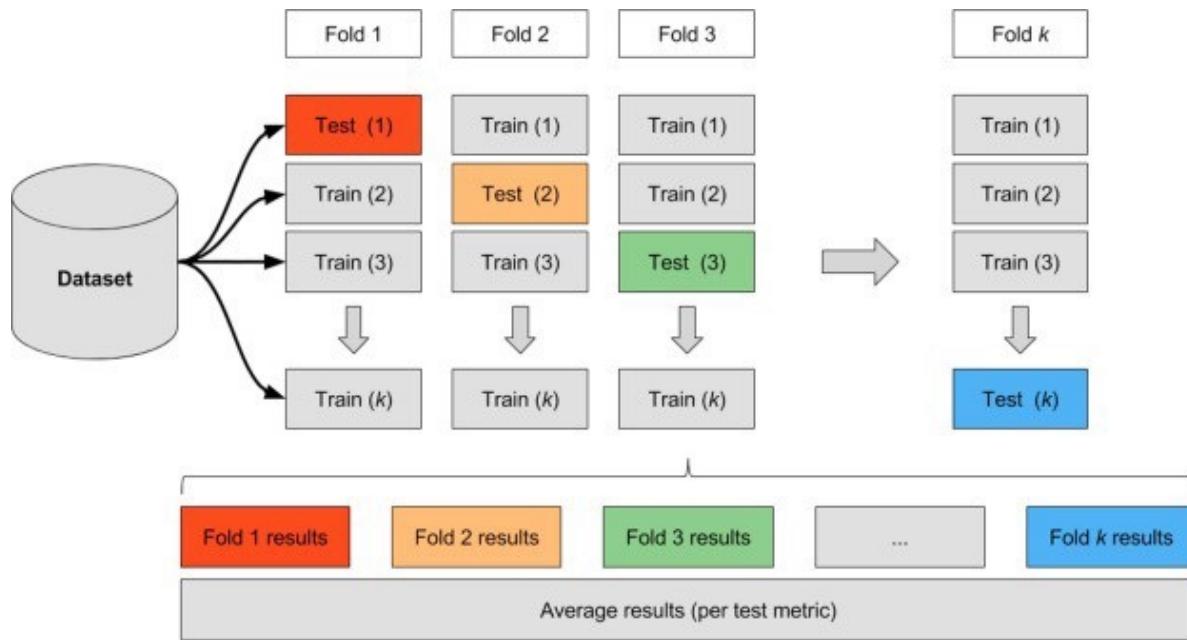
K-Fold Cross Validation (i)

Fold 1	Fold 2	...	Fold k
--------	--------	-----	----------

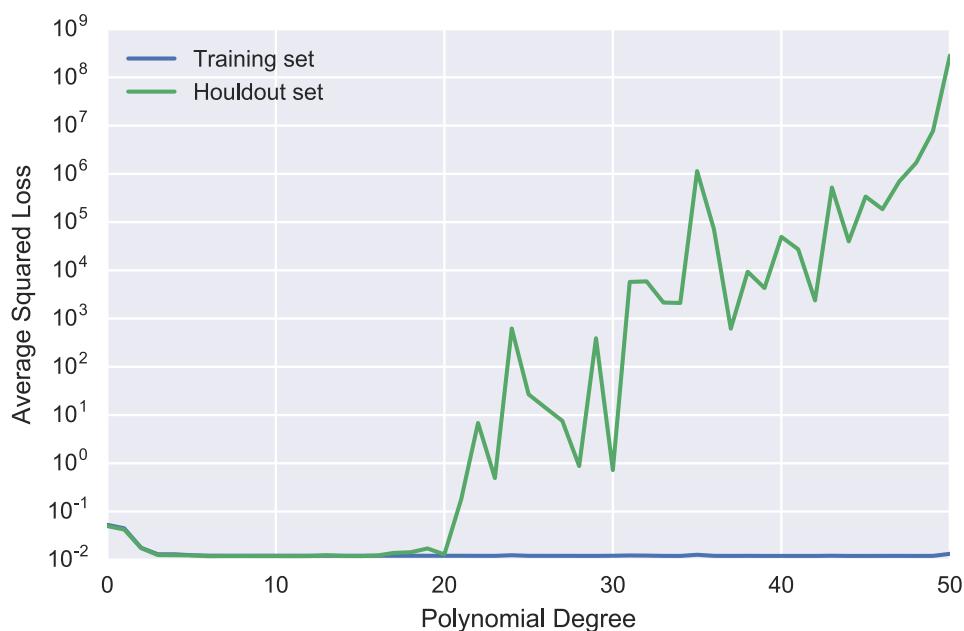
- si suddividono i dati in k sottoinsieme disgiunti
- un sottoinsieme è usato come validation set e gli altri $k-1$ come training set
- si ripete il procedimento k volte con ciascuno dei k subset
- si ottengono k modelli di learning, e.g. k regressioni
- l'accuratezza è la media delle accuratezze dei k modelli
- k-fold cross validation stratificata
 - stessa distribuzione e caratteristiche dei dati in ogni fold



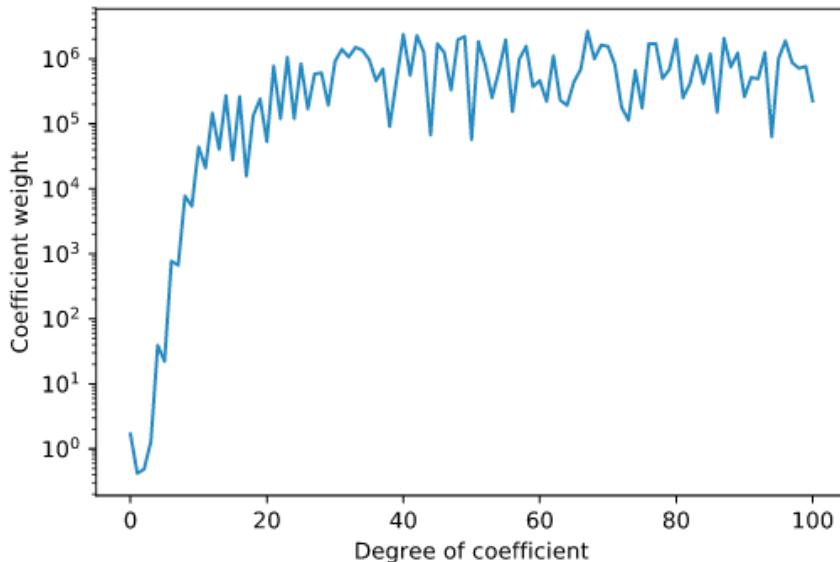
K-Fold Cross Validation (ii)



Regressione Polinomiale: l'Errore Aumenta al variare del grado (con Holdout), perché ?



Regressione Polinomiale: Aumento dei coefficienti θ all'aumentare del grado



- esempio sulla previsione del consumo di elettricità
- aumentando il grado del polinomio, aumenta rapidamente il valore assoluto di θ

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

25



Regolarizzazione: *Ridge Regression*

- Il grado nella regressione polinomiale misura la complessità del modello di learning
 - con grado teoricamente infinito possiamo modellare qualsiasi data set
- ma i coefficienti del polinomio, e.g. grado 50, diventano grandi

$$\theta = -3.88 \times 10^6, 7.60 \times 10^6, 3.94 \times 10^6, -2.60 \times 10^7, \dots$$

ciò provoca forti oscillazioni nella regressione peggiorandone l'accuratezza

- regolarizzare significa ridurre il valore dei coefficienti, come ?
- si aggiunge alla funzione d'errore da minimizzare anche $\lambda \cdot \theta$
 - $0 \leq \lambda < \infty$ (iperparametro), con $\lambda = 0$ nessuna regolarizzazione

$$\underset{\theta}{\text{minimize}} \sum_{i=1}^m (\theta^T x^{(i)} - y^{(i)})^2 + \lambda \|\theta\|_2^2 \quad \|\theta\|_2^2 = \sum_{i=0}^{n-1} \theta_i^2 \quad n = \text{num. parametri } \theta$$

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

26



Minimizzazione dell'errore con Regolarizzazione

$$\underset{\theta}{\text{minimize}} \sum_{i=1}^m (\theta^T x^{(i)} - y^{(i)})^2 + \lambda \|\theta\|_2^2$$

- per minimizzare come al solito calcoliamo la derivata prima

$$\nabla_{\theta} \left(\sum_{i=1}^m (\theta^T x^{(i)} - y^{(i)})^2 + \lambda \|\theta\|_2^2 \right) = 2X^T(X\theta - y) + 2\lambda\theta$$

- e troviamo il gradiente ponendo la derivata a zero

$$2X^T X\theta + 2\lambda\theta = 2X^T y \implies \theta = (X^T X + \lambda I)^{-1} X^T y$$

– la soluzione ha un termine nuovo λI dove I è la matrice identità

– perciò più λ è grande, più si riducono i coefficienti θ

- nota importante sul termine* $\|\theta\|_2^2 = \sum_{i=0}^{n-1} \theta_i^2$

– la scala delle variabili di input si riflette sui parametri θ e poiché ora si sommano, incidentalmente predominerebbero quelli con scala maggiore → **standardizzare le variabili di input**



Regolarizzazione: Interpretazione Geometrica

- Senza perdita di generalità consideriamo una regressione con parametri θ

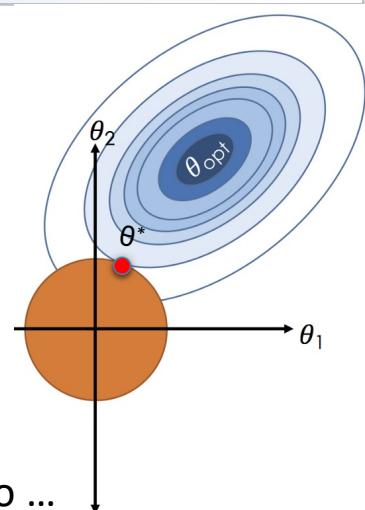
$$\hat{y} = \theta_0 + \theta_1 \cdot x_1 + \theta_2 \cdot x_2$$

- θ_{opt} è il punto che minimizza la funzione di errore (θ_0 è costante con dati standardizzati)

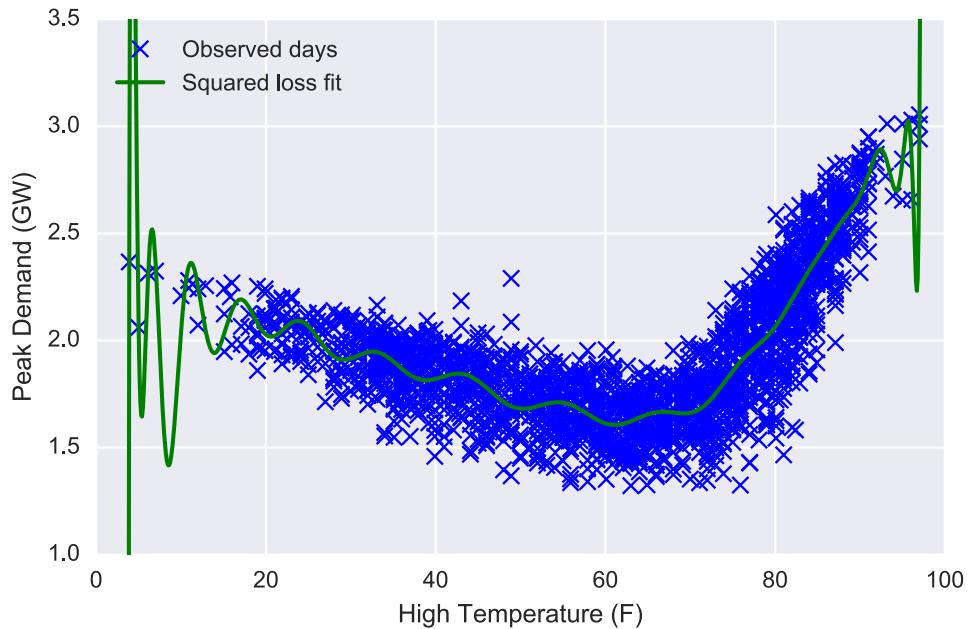
– in blu le curve di livello della funzione d'errore

- minimizzare la funzione d'errore aggiungendo $\lambda \|\theta\|_2^2$ corrisponde a trovare una soluzione θ^* (punto rosso) di minimo vincolato ...

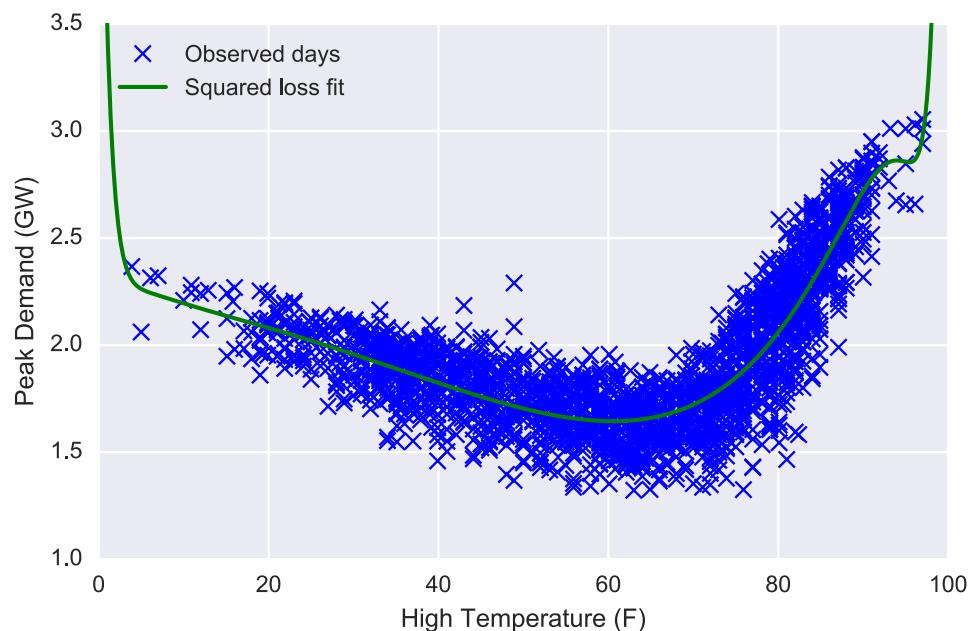
- ... all'interno della relativa disequazione $\theta_1^2 + \theta_2^2 \leq r^2$
i.e. ipersfera centrata in 0,0 con raggio r che dipende da λ
- all'aumentare di λ , si riduce r e la soluzione tende ad avvicinarsi all'origine con θ minori



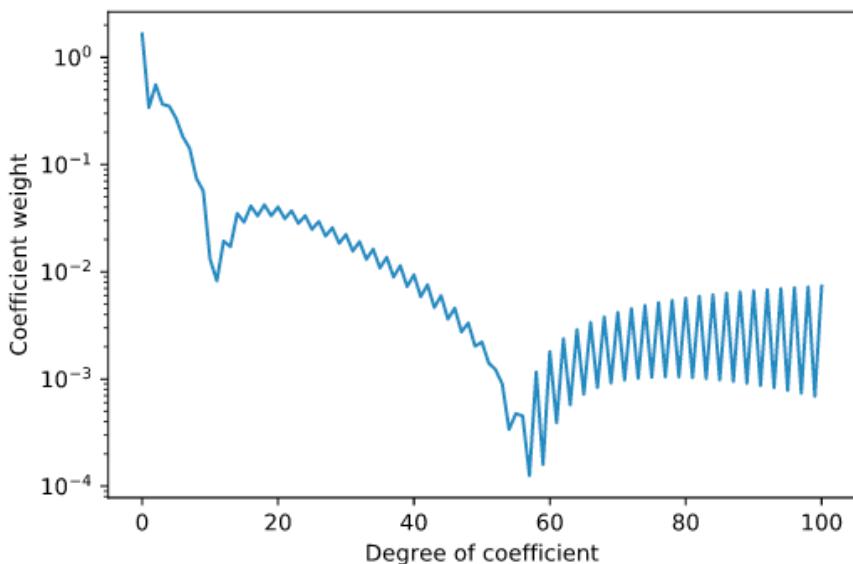
Regressione Polinomiale: grado 50 senza regolarizzazione



Regressione Polinomiale: grado 50 con regolarizzazione $\lambda = 1$



Regressione Polinomiale: Effetto della Regolarizzazione al variare del grado



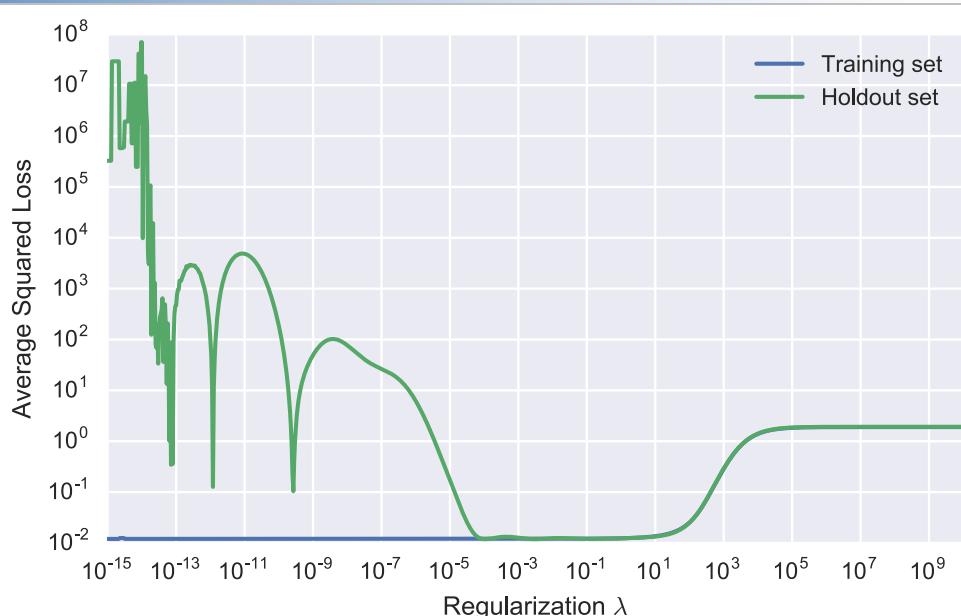
- esempio sulla previsione del consumo di elettricità
- Pur aumentando il grado, la regolarizzazione riduce molto il valore di θ
 - da 10^6 a 10^{-3}

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

32



Regressione Polinomiale: Accuratezza con grado 50 al variare di λ



la regolarizzazione è un altro iperparametro da ottimizzare rispetto al validation set; lo si trova con cross validation

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

33



Individuazione del Migliore λ

- Il metodo più semplice per determinarlo è usare la k-fold cross validation: in python l'iperparametro λ è chiamato α

```
from sklearn.linear_model import RidgeCV
...
# 25 ascisse  $\lambda$  del grafico precedente da  $10^{-15}$  a  $10^9$ 
alphas = 10**np.linspace(-15, 9, 25)
reg_cv = RidgeCV(alphas, cv=5) # 5-cross fold
reg_cv.fit(poly.fit_transform(X_train), y_train)
reg_cv.score(poly.transform(X_val), y_val)
>>> 0.01102
reg_cv.alpha_ # alpha migliore
>>> 0.1
```

- determinare gli iperparametri migliori con gli stessi dati usati per estrarre il modello migliore genera score ottimisti, usare **Nested Cross Validation** in questo caso per stimare correttamente anche lo score su dati ignoti

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

34

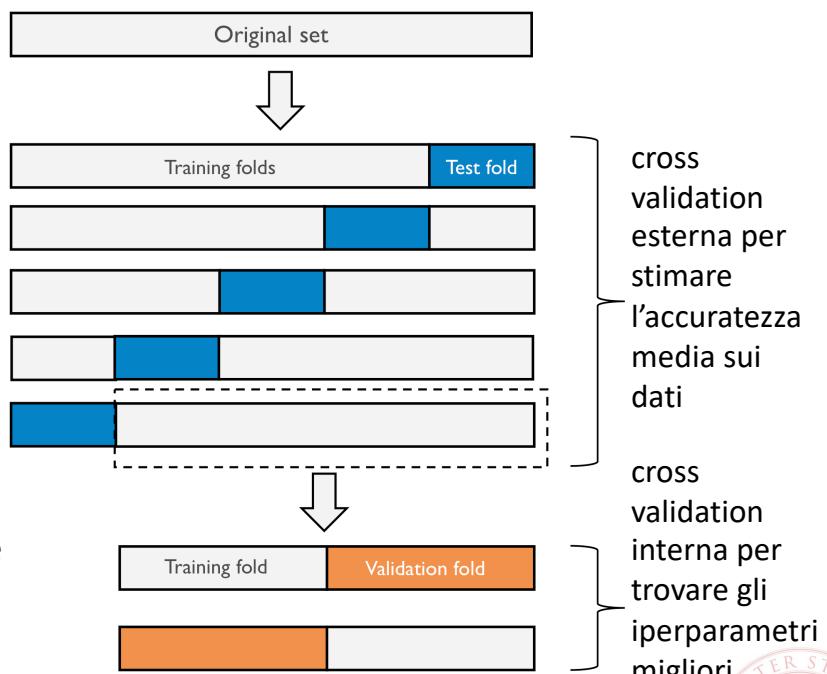


Nested Cross Validation (i)

Ogni parte di training (grigia) della k-fold cross validation esterna è suddivisa nella cross validation interna in m-subfold che sono usati per individuare gli iperparametri migliori

Gli iperparametri migliori sono poi usati per addestrare e **testare** il modello nella relativa parte della validation esterna

Non estrae un modello migliore di un altro, ma **stima gli iperparametri** per estrarre il modello migliore

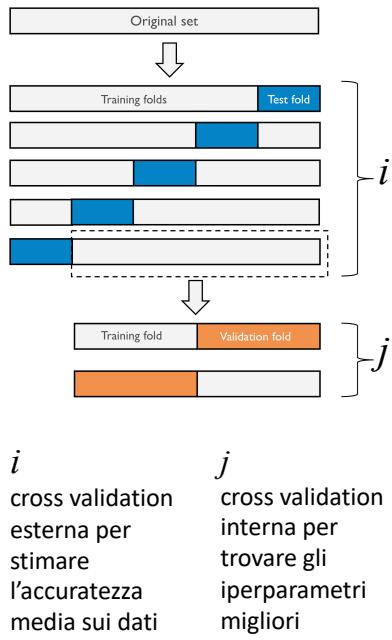


Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

35



Nested Cross Validation (ii)



Pseudocodifica del Funzionamento

```

Require:  $K_1, K_2$ , where  $K_1$  is number of outer folds and  $K_2$  inner folds
Require:  $\mathcal{D}$ , dataset containing input features  $X$  and output feature  $y$ 
Require:  $P_{sets}$ , set of hyperparameters with different values
Require:  $\mathcal{M}$ , a single estimator, model.

for  $i = 1$  to  $K_1$  splits do
    Split  $\mathcal{D}$  into  $\mathcal{D}_i^{train}, \mathcal{D}_i^{test}$  for the  $i$ 'th split
    for  $j = 1$  to  $K_2$  splits do
        Split  $\mathcal{D}_i^{train}$  into  $\mathcal{D}_j^{train}, \mathcal{D}_j^{test}$  for the  $j$ 'th split
        foreach  $p$  in  $RandomSample(P_{sets})$  do
            Train  $\mathcal{M}$  on  $\mathcal{D}_j^{train}$  with hyperparameter set  $p$ 
            Compute test error  $E_j^{test}$  for  $\mathcal{M}$  with  $\mathcal{D}_j^{test}$ 
    Select optimal hyperparameter set  $p^*$  from  $P_{sets}$ , where  $E_j^{test}$  is best
    Train  $\mathcal{M}$  with  $\mathcal{D}_i^{train}$ , using  $p^*$ 
    Compute test error  $E_i^{test}$  for  $\mathcal{M}$  with  $\mathcal{D}_i^{test}$ 

```

Al termine **il modello migliore si ottiene addestrando su tutti i dati** utilizzando per ogni iperparametro il valore che ha dato **il risultato medio migliore**, e.g. $\lambda = 0.1$, grado polinomio = 10



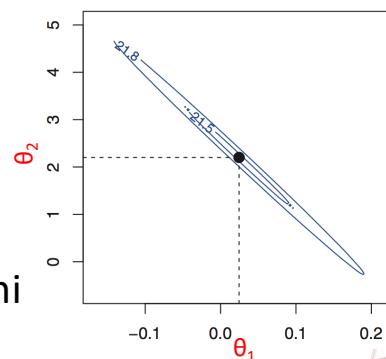
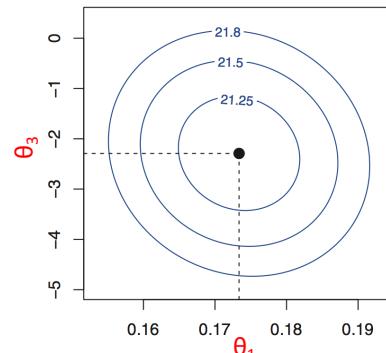
Collinearità: Dipendenze tra Variabili di Input (i)

- Nella regressione ordinaria si assume che le variabili di input siano indipendenti tra loro
- Con dipendenze la regressione è instabile, i.e. piccole variazioni nei dati generano modelli molto diversi e inaffidabili
 - un'azienda scopre dai dati di campagne pubblicitarie su giornali, radio e TV, che l'aumento maggiore delle vendite si ottiene con radio e TV
 $Vendite = \theta_0 + \theta_1 \cdot TV + \theta_2 \cdot Radio + \theta_3 \cdot Giornali$ i.e. $\theta_1 > \theta_2 > \theta_3$
 - scopre anche che maggiore è la pubblicità in radio, maggiore è il ritorno della pubblicità in TV → c'è qualche dipendenza tra **TV** e **radio**
 - quindi investendo 100 solo in TV o solo in radio, si ottiene un aumento delle vendite inferiore rispetto ad investire 50 in TV e 50 in radio
 - Effetto noto nel marketing come sinergia, nel Statistical Learning come interazione: una soluzione è aggiungere un nuovo parametro che combina le due variabili → $\theta_4 \cdot TV \cdot radio$



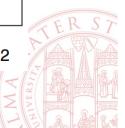
Collinearità: Dipendenze tra Variabili di Input (ii)

- Nella fig. in alto l'errore di regressione minimo usando solo θ_1, θ_3 è ben definito (e.g. $\theta_{\text{radio}}, \theta_{\text{giornali}}$)
- sotto invece con θ_1, θ_2 un ampio num. di loro valori produce lo stesso minimo → ampio n. di soluzioni (e.g. $\theta_{\text{radio}}, \theta_{\text{TV}}$)
 - training set con differenze trascurabili generano modelli di regressione con coefficienti molto diversi -> soluzione instabile causata da dipendenza tra θ_1 e θ_2
 - accuratezza imprevedibile su dati ignoti
- la regolarizzazione risolve il problema poiché vincola/riduce le possibili soluzioni
 - soluzioni vincolate intorno all'origine



Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

39

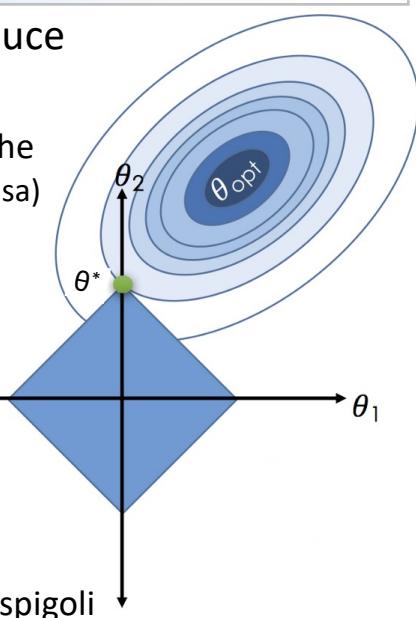


Regressione LASSO

- La regressione Ridge, all'aumentare di λ riduce ma non azzerà il valore dei parametri θ
 - perciò la soluzione utilizza tutte le variabili, anche quelle irrilevanti per la predizione (soluzione densa)
- Se penalizziamo i θ nella minimizzazione dell'errore con norma L1 invece che L2

$$\underset{\theta}{\text{minimize}} \sum_{i=1}^m (\theta^T x^{(i)} - y^{(i)})^2 + \lambda \|\theta\|_1 : \|\theta\|_1 = \sum_{j=1}^n |\theta_j|$$

- la soluzione θ^* è vincolata all'interno di un ipercubo centrato sull'origine
 - maggior è λ** , più è probabile che θ^* cada sugli spigoli azzerando diversi θ , più **variabili irrilevanti si eliminano**, **soluzione sparsa**
 - modello predittivo più interpretabile; tecnica per selezionare variabili

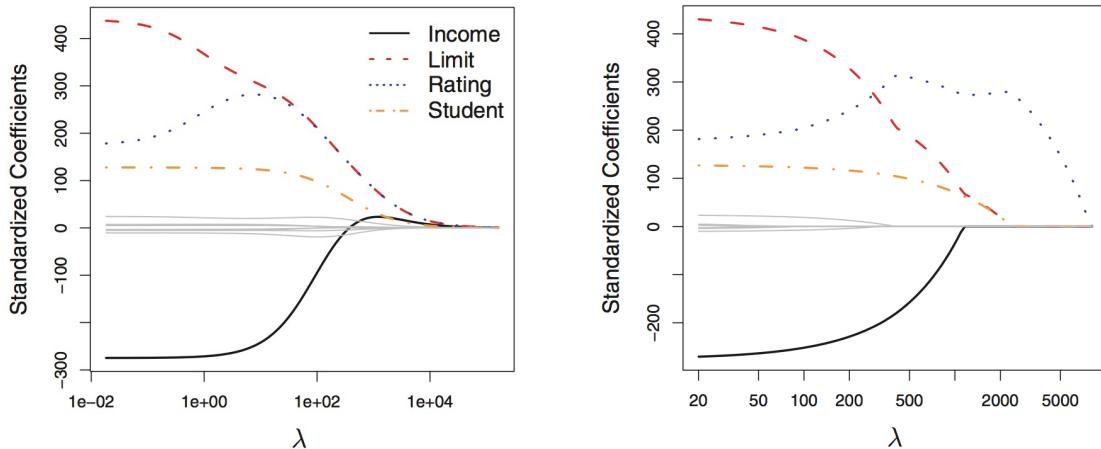


Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

40



Esempio Grafico di Selezione di Variabili con Lasso



- I grafici mostrano la riduzione dei valori dei parametri di regressione **Ridge (sx)** e **LASSO (dx)** all'aumentare di lambda
 - Previsione dell'insolvenza con carte di credito
 - con Ridge tutte le variabili, comprese quelle irrilevanti in grigio chiaro si riducono ma non si azzerano, con LASSO le irrilevanti si azzerano

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

41



Selezione di Feature con P-Value in Python

- p-value indica la probabilità che il valore del coefficiente sia casuale
 - E.g. p-value 0.06 del coefficiente theta_1
- p-value è impiegato in combinazione con un livello di confidenza
 - E.g. con confidenza dello 0.95, il coefficiente theta_1 è scartato
- In python
 - `from sklearn import linear_model`
 - `from regressors import stats`
 - `ols = linear_model.LinearRegression()`
 - `ols.fit(X, y)`
 - `stats.coef_pval(ols, X, y)`

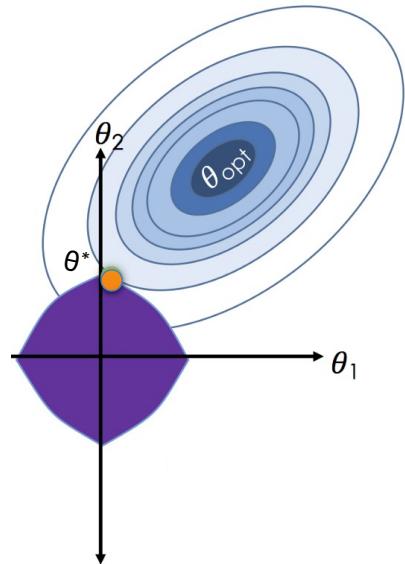


Regressione Elastic Net: L1+L2

- Generalizza Ridge e LASSO con entrambe le penalizzazioni dei θ con norma L1 e L2

$$\underset{\theta}{\text{minimize}} \sum_{i=1}^m (\theta^T x^{(i)} - y^{(i)})^2 + \lambda (\alpha \|\theta\|_1 + (1-\alpha) \|\theta\|_2^2)$$

- introduce un secondo iperparametro α per pesare le penalizzazioni L1 e L2
 - con $\alpha = 0$ è la regressione Ridge, con $\alpha = 1$ è la regressione LASSO; valori intermedi combinano le due penalizzazioni ed i loro pro e contro
 - in python l'iperparametro α è `l1_ratio` e λ è α



Regressione Polinomiale: Quanti parametri θ con **10** variabili indipendenti e grado **2** ?

- Il numero di variabili indipendenti sono quelle del data set
 - e.g. nella previsione del prezzo delle case le variabili sono una decina: *num. stanze, diversi quartieri (var binarie), metri quadri, num. piano ...*
 - $h_{\theta}(x_1, \dots, x_{10})^2 = \theta_0 + \theta_1 x_1 + \theta_2 x_2 + \dots + \theta_{10} x_{10} + \theta_{11} x_1^2 + \theta_{12} x_1 x_2 + \dots + \theta_{90} x_{10}^2 + \theta_{91} x_1^3 + \theta_{92} x_1^2 x_2 + \dots + \theta_{100} x_{10}^3 + \dots + \theta_{101} x_1^4 + \dots + \theta_{1000} x_{10}^4 + \dots + \theta_{1001} x_1^5 + \dots + \theta_{10000} x_{10}^5 + \dots + \theta_{10001} x_1^6 + \dots + \theta_{100000} x_{10}^6 + \dots + \theta_{100001} x_1^7 + \dots + \theta_{1000000} x_{10}^7 + \dots + \theta_{1000001} x_1^8 + \dots + \theta_{10000000} x_{10}^8 + \dots + \theta_{10000001} x_1^9 + \dots + \theta_{100000000} x_{10}^9 + \dots + \theta_{100000001} x_1^10 + \dots + \theta_{1000000000} x_{10}^{10} + \dots + \theta_{1000000001}$
 - 66 termini** le dimensioni del data set aumentano di quasi 7 volte !!
 - Problemi ad elevata dimensionalità:** se il numero di variabili è maggiore, o dello stesso ordine di grandezza, rispetto al numero delle istanze



Regressione Polinomiale: Quanti parametri θ con n variabili e grado g ?

- $h_{\theta}(x_1, \dots, x_n)^g = \dots ??$
- il polinomio di grado 2 in n variabili genera $\frac{(n+1)(n+2)}{2} = \binom{n+2}{2}$ termini
- il polinomio di grado g in n variabili genera $\binom{n+g}{g}$ termini
 - e.g. previsione del consumo energetico dalla **temperatura e dal tipo del giorno (feriale o festivo)** della settimana:
 - con 2 variabili e grado 10 otteniamo l'accuratezza migliore \rightarrow 66 variabili, ma la quantità di dati aumenta però di 33 volte
 - e.g. **10 variabili e grado 10** generano **184756** parametri prima ancora di effettuare la regressione \rightarrow **approccio non scalabile**
 - **Regola generale: all'aumentare di n diminuire g e viceversa**
 - prima di procedere calcolare il numero di variabili derivate da n e g
- **E' possibile mappare i dati originali in un nuovo spazio ad elevata dimensionalità senza creare le relative nuove variabili ? Fantascienza ??**

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

46



Soluzione all'Esplosione della Dimensionalità (i)

La Scienza a volte Supera la Fantascienza

- sembra assurdo, ma possiamo portare i dati in nuovi spazi ad elevata dimensionalità senza creare nuove variabili, **come ?**
- e.g. consideriamo questo polinomio $(1+x_1z_1 + x_2z_2)^2$
 - dove $x = (x_1, x_2)$ e $z = (z_1, z_2)$ 2 dati di input con le loro **2 dimensioni**
 - $$(1 + x_1z_1 + x_2z_2)^2 = x_1^2z_1^2 + 2x_1x_2z_1z_2 + x_2^2z_2^2 + 2x_1z_1 + 2x_2z_2 + 1$$
 - sviluppando abbiamo 6 termini che corrispondono anche al prodotto scalare dei due vettori seguenti
- $$(x_1^2, x_1x_2\sqrt{2}, x_2^2, x_1\sqrt{2}, x_2\sqrt{2}, 1) \cdot (z_1^2, z_1z_2\sqrt{2}, z_2^2, z_1\sqrt{2}, z_2\sqrt{2}, 1)$$
- ciò corrisponde al mapping in **6 dimensioni** dei 2 vettori x e z in **2D**
- $$(x_1, x_2) \xrightarrow{\phi} (x_1^2, x_1x_2\sqrt{2}, x_2^2, x_1\sqrt{2}, x_2\sqrt{2}, 1) \quad (z_1, z_2) \xrightarrow{\phi} (z_1^2, z_1z_2\sqrt{2}, z_2^2, z_1\sqrt{2}, z_2\sqrt{2}, 1)$$
- costi: **triplicate le dimensioni** iniziali dei dati ... ANDIAMO AVANTI



Soluzione all'Esplosione della Dimensionalità (ii)

Funzioni Kernel

- sviluppiamo interamente il polinomio di prima

$$\begin{aligned}
 (1 + x_1 z_1 + x_2 z_2)^2 &= x_1^2 z_1^2 + 2x_1 x_2 z_1 z_2 + x_2^2 z_2^2 + 2x_1 z_1 + 2x_2 z_2 + 1 \\
 &= (x_1 z_1 + x_2 z_2)^2 + 2(x_1 z_1 + x_2 z_2) + 1 \\
 &= (x^T z)^2 + 2(x^T z) + 1 \\
 &= (x^T z + 1)^2
 \end{aligned}$$

- cosa c'è di interessante nel risultato finale ?

- il quadrato del prodotto scalare dei vettori iniziali x ed z in 2 dimensioni
+ 1 è uguale al prodotto scalare dei vettori trasformati in 6 dimensioni
 $((x_1, x_2) \cdot (z_1, z_2) + 1)^2 = (x_1^2, x_1 x_2 \sqrt{2}, x_2^2, x_1 \sqrt{2}, x_2 \sqrt{2}, 1) \cdot (z_1^2, z_1 z_2 \sqrt{2}, z_2^2, z_1 \sqrt{2}, z_2 \sqrt{2}, 1)$
- ciò dimostra che $((x_1, x_2) \cdot (z_1, z_2) + 1)^2$ equivale a lavorare in uno spazio a 6 dimensioni senza creare nuove variabili dallo spazio 2D iniziale
 - Il quadrato della somma di **2 moltiplicazioni** $x_1 z_1, x_2 z_2$ produce lo stesso effetto della somma di **6 moltiplicazioni**
- KERNEL TRICK:** vale per ogni grado g e num. n di dimensioni
 - $\mathbf{x} = (x_1, \dots, x_n) \quad \mathbf{z} = (z_1, \dots, z_n) \quad \text{Kernel}(\mathbf{x}, \mathbf{z}) = (\mathbf{x} \cdot \mathbf{z} + 1)^g$

Gianluca Moro - DISI, Università di Bologna

48



Soluzione all'Esplosione della Dimensionalità (iii)

Costi Computazionali con e senza Kernel

- costi senza e con $\text{Kernel}(\mathbf{x}, \mathbf{z}) = (\mathbf{x} \cdot \mathbf{z} + 1)^g$ polinomiale
 - senza kernel, con **grado g** ed **n dimensioni** il costo è $O(r^2 n^g / 2^g)$
 - e.g. $n = 100, g = 4, 1000$ istanze $\rightarrow 1000^2 / 2 \times 4421275 \approx 2.21 \times 10^{12}$
 - con kernel il costo è costante all'aumentare del grado $g \rightarrow O(r^2 n^2 / 2)$
 - come sopra $n = 100, g = 4, 1000$ istanze $\rightarrow 1000^2 / 2 \approx 5 \times 10^5$
- e.g. num. di termini polinomiali con alcune dimensioni e gradi

Grado del polinomio di trasformazione	$\phi(\mathbf{x}) \cdot \phi(\mathbf{z})$	$\phi(\mathbf{x})$: num. dimensioni con n dimensioni iniziali	E.g. con 100 dimensioni ed $r^2 / 2$	Con Kernel Trick	E.g. con 100 dimensioni
2	$(\mathbf{x} \cdot \mathbf{z})^2$	$n(n+1)/2$	$2525 r^2$	$n r^2 / 2$	$50 r^2$
3	$(\mathbf{x} \cdot \mathbf{z})^3$	$n(n+1)(n+2)/6$	$85850 r^2$	$n r^2 / 2$	$50 r^2$
4	$(\mathbf{x} \cdot \mathbf{z})^4$	$n(n+1)(n+2)(n+3)/24$	$2.21 \times 10^6 r^2$	$n r^2 / 2$	$50 r^2$

Gianluca Moro - DISI, Università di Bologna

49



Altre Funzioni Kernel

- Kernel (non lineari) possono modellare dati set complessi con distribuzioni non lineari
 - senza aumentare le dimensioni dei dati e dei relativi costi impossibili da sostenere per operare nello spazio ad elevata dimensionalità
- Limite: possono generare modelli affetti da overfitting

Proprietà delle Funzioni Kernel $K(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = (\mathbf{x} \cdot \mathbf{y})$

Polinomiale: $K(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = (\mathbf{x} \cdot \mathbf{y} + \theta)^g$

Gaussian Radial Basis: $K(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = e^{(-\gamma \|\mathbf{x} - \mathbf{y}\|^2)}$ con $\gamma = \frac{1}{2\sigma^2}$

Sigmoidale: $K(\mathbf{x}, \mathbf{y}) = \tanh(k \mathbf{x} \cdot \mathbf{y} - \delta)$

dove $0 \leq \theta \in R, g \in N, k, \delta \in R$



la Magia delle Funzioni Kernel

- Il caso della previsione del consumo di elettricità dimostra che
 - la regressione lineare è inadeguata e che un polinomio di grado 10 o 50 ottiene risultati molto più accurati
 - ma un polinomio di **grado 10 con 2 variabili** (temperatura e giorno della settimana) genera 66 variabili → **33 volte i dati e costi della reg. lineare**
 - con grado 50** l'accuratezza migliora ancora ma servono **1326 variabili** e la quantità di dati aumenta di oltre **600 volte**
 - col **kernel polinomiale di grado 50** ogni dato ha **1326 dimensioni, senza creare nemmeno una** delle 1326 variabili
- Come sfruttiamo il kernel nella regressione ?

Esempio di regressione quadratica in una variabile

$$\begin{aligned} h_{\theta}(x) &= \theta_0 + \theta_1 x + \theta_2 x^2 = (\theta_0, \theta_1, \theta_2) \cdot (1, x, x^2) \\ &= \boldsymbol{\theta}^T \phi(x) \quad \text{dove } \phi(x) \text{ è la trasformazione di } x \end{aligned}$$



Come Incorporare le Funzioni Kernel nella Regressione ?

$h_{\theta}(x) = \theta_0 + \theta_1 x + \theta_2 x^2 = (\theta_0, \theta_1, \theta_2) \cdot (1, x, x^2)$ es. di Regressione quadratico in una variabile

$$= \boldsymbol{\theta}^T \phi(x) \text{ dove } \phi(x) \text{ è la trasformazione di } x, \text{ ma } \boldsymbol{\theta}^T = \sum_{i=1}^m \alpha_i \phi(x^{(i)})$$

$$= \sum_{i=1}^m \alpha_i \phi(x) \phi(x^{(i)}) \quad \phi(x^{(i)}) \text{ è la trasformazione di ogni istanza } x^{(i)} \text{ diversa da } x$$

$$= \sum_{i=1}^m \alpha_i K(x, x^{(i)}) \quad K \text{ è il kernel che sostituisce le due trasformazioni } \phi(x) \phi(x^{(i)})$$

i coefficienti ottimali θ sono combinazioni lineari dei dati

- perché c'è la sommatoria benché ci sia 1 sola variabile x indipendente ?

- la funzione kernel polinomiale moltiplica due dati di input x e z

$$K(x, z) = (1 + x^T z)^d$$

- la sommatoria qui introduce il prodotto tra il dato di input x e tutti gli altri m dati $x^{(i)}$ $i=1,..,m$ del data set e per ciascuno c'è un proprio parametro α_i da apprendere

→ complessità di training circa quadratica rispetto al num. istanze

Gianluca Moro - DISI, Università di Bologna

52



Minimizzare la Funzione di Errore con Kernel

- Ricordiamo la funzione di errore da minimizzare $\underset{\theta}{\text{minimize}} \sum_{i=1}^m (\theta^T x^{(i)} - y^{(i)})^2 + \lambda \|\theta\|_2^2$

- Come diventa con Kernel ? Iniziamo dal quadrato della norma di θ

– il vettore θ^* dei parametri ottimali è → $\theta^* = \sum_{i=1}^m \alpha_i \phi(x^{(i)})$ i coefficienti ottimali θ^* sono combinazioni lineari dei dati

$$\|\theta\|_2^2 = \theta^T \theta = \left(\sum_{i=1}^m \alpha_i \phi(x^{(i)})^T \right) \left(\sum_{j=1}^m \alpha_j \phi(x^{(j)}) \right) = \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^m \alpha_i \alpha_j K(x^{(i)}, x^{(j)})$$

= $\alpha^T K \alpha$ – notazione vettoriale

– dove $K \in \mathbb{R}^{m \times m}$ è la matrice quadrata $K_{ij} = K(x^{(i)}, x^{(j)})$ con i valori kernel di tutte le coppie dei dati

$$\underset{\alpha}{\text{minimize}} \quad \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m \left(\sum_{j=1}^m \alpha_j K(x^{(j)}, x^{(i)}) - y^{(i)} \right)^2 + \lambda \alpha^T K \alpha$$

$$\underset{\alpha}{\text{minimize}} \quad \frac{1}{m} \|K \alpha - y\|_2^2 + \lambda \alpha^T K \alpha$$

l'i-esimo elemento del vettore $K \alpha - y$ è il quadrato della sommatoria interna; il risultato è la sommatoria di quadrati di un vettore, i.e. una norma al quadrato

Gianluca Moro - DISI, Università di Bologna

53



Gradiente della Regressione con Kernel

- derivata della funzione d'errore rispetto ai parametri α

$$\nabla_{\alpha} \left(\frac{1}{m} \|K\alpha - y\|_2^2 + \lambda \alpha^T K \alpha \right) = \frac{2}{m} K(K\alpha - y) + 2\lambda K\alpha$$

- poniamola a zero e otteniamo il vettore gradiente α

$$2KK\alpha + 2\lambda mK\alpha = 2Ky$$

$$(K + \lambda mI)\alpha = y$$

$$\alpha = (K + \tilde{\lambda}I)^{-1}y$$

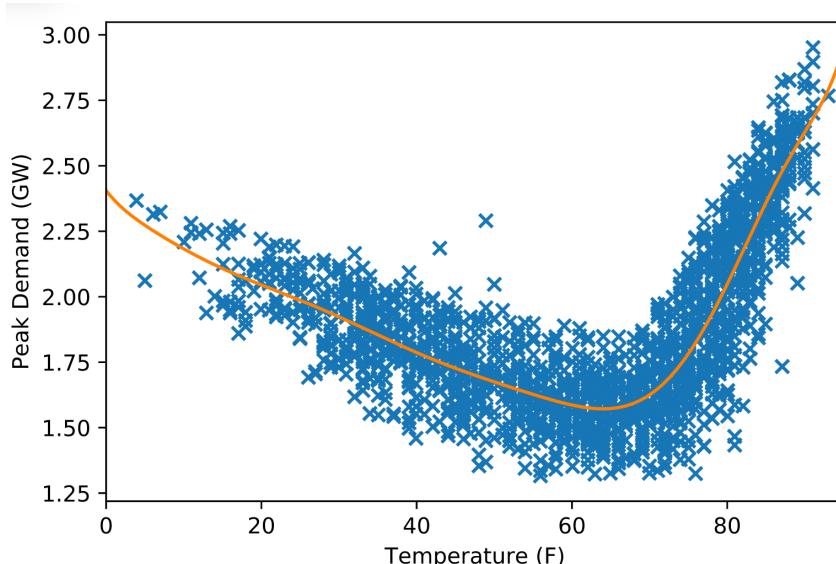
- dove il termine m è stato incorporato in $\tilde{\lambda}$. Attenzione: la matrice K è calcolata prima di effettuare la regressione
- Questa regressione è nota come **KERNEL RIDGE REGRESSION** ed è implementata in Python nel package scikit-learn
 - nell'implementazione Python l'iperparametro λ è chiamato α

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

54



Kernel Ridge Regression Applicata alla Previsione del Consumo Elettrico



Con polinomio di grado 10 e $\lambda = 10^{-6}$ otteniamo lo stesso risultato di prima ma senza generare alcuna nuova variabile rispetto al data set

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

55

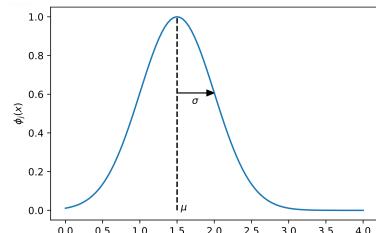


Gaussian Radial Basis Function (RBF)

- E' una funzione non lineare più complessa della polinomiale

- Restituisce un vettore di k (parametro) componenti con valore in $[0, 1]$, 1 se x , il dato in input, coincide con $\mu^{(i)}$ (parametri). Più x è distante da $\mu^{(i)}$, più il valore si avvicina a zero secondo la relativa distribuzione a campana con ampiezza σ (parametro)
- RBF modella i dati sottostanti con combinazioni lineari di queste k funzioni a campana simili a Gaussiane (può approssimare qualsiasi funzione)
- Più aumenta k , più il modello diventa complesso
Più aumenta σ più il modello diventa semplice
- Scelta di σ : uguale alla mediana della distanza tra i dati ed i centri μ , in Python
- I μ centri sono scelti di norma a caso tra i dati per migliorarne la distribuzione nello spazio dei dati

$$\phi(x) : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^k = \begin{bmatrix} \exp\left(\frac{-(x-\mu^{(1)})^2}{2\sigma^2}\right) \\ \exp\left(\frac{-(x-\mu^{(2)})^2}{2\sigma^2}\right) \\ \vdots \\ \exp\left(\frac{-(x-\mu^{(k-1)})^2}{2\sigma^2}\right) \\ 1 \end{bmatrix}$$



```
D = sqdist(X,X); sigma = np.median(np.sqrt(D)); K = np.exp(-D/(2*sigma**2))
```

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

56



Gaussian Radial Basis Function (RBF) Kernel ad Infinite Dimensioni

- la versione RBF multi-dimensionale: $\phi(x) = \left\{ \exp\left(\frac{-\|x - \mu^{(j)}\|_2^2}{2\sigma^2}\right) : i = 1, \dots, k-1 \right\} \cup \{1\}$
 - x e $\mu^{(j)}$ qui sono vettori perciò il quadrato della loro differenza si ottiene con il quadrato della norma euclidea delle loro differenze
 - a differenza di quella mono-dimensionale, qui occorre normalizzare i dati
- la versione Kernel si applica come quella polinomiale senza modificare l'algoritmo $K(x, z) = \exp\left(-\frac{\|x - z\|_2^2}{2\sigma^2}\right)$
- perché è un Kernel ad infinite dimensioni ?
 - RBF corrisponde al prodotto scalare tra 2 vettori ad infinite dimensioni $\phi(x)^T \phi(z)$, i.e. ognuno ha un centro in ogni punto dello spazio dei dati
 - infatti secondo l'espansione di Taylor delle funzioni esponenziali, $e^x = \sum_{i=0}^{\infty} \frac{1}{i!} x^i = \frac{1}{1!} x^1 + \frac{1}{2!} x^2 + \frac{1}{3!} x^3 + \frac{1}{4!} x^4 + \dots$ corrisponde ad un polinomio di grado infinito; poiché il grado determina la dimensionalità, allora la dimensionalità è infinita

Applicazioni Data Intensive - G. Moro, R. Pasolini - DISI, Università di Bologna, Cesena

57

