回顾

- 什么是监督学习? 监督学习任务主要有哪些?
- 监督学习基本步骤有哪些?
- 什么时候要用到模型评估?主要有哪些评估方法?
- 分类模型好坏的常用性能度量有哪些?

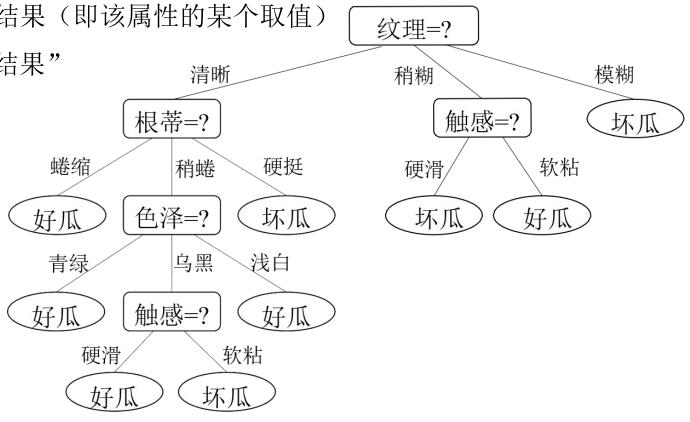
第四章 分类

- 4.1 模型评估和性能度量
- 4.2 k最近邻分类
- 4.3 决策树
 - 4.3.1决策树概况
 - 4.3.2决策树构造
 - 4.3.3剪枝
- 4.4 贝叶斯分类
- 4.5 组合分类
- 4.6 案例:信用违约预测

决策树模型-概况

决策树基于"树"结构进行决策

- □ 每个"内部结点"对应于某个属性上的"测试"(test)
- □ 每个分支对应于该测试的一种可能结果(即该属性的某个取值)
- □ 每个"叶结点"对应于一个"预测结果"



决策树模型-概况

预测过程:

将测试示例从根结点开始,沿着划分属性所构成的"判定测试序列"

下行,直到叶结点。

下面的西瓜是好瓜吗?

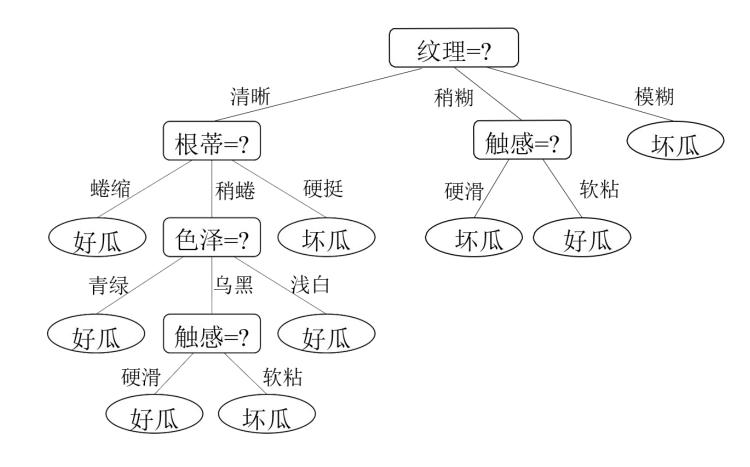
色泽:青绿

根蒂: 蜷缩

敲声 沉闷

纹理:清晰

触感: 硬滑



决策树模型-概况

学习过程:通过对训练样本的分析来确定"划分属性"(即内部结点所对应的属性)

4 青绿 蜷缩 沉闷 清晰 凹陷 硬滑 是 ()									
2 乌黑 蜷缩 沉闷 清晰 凹陷 硬滑 是 3 乌黑 蜷缩 浊响 清晰 凹陷 硬滑 是 4 青绿 蜷缩 浊响 清晰 凹陷 硬滑 是 5 浅白 蜷缩 浊响 清晰 凹陷 硬滑 是 6 青绿 柏蜷 浊响 清晰 科凹 软粘 是 7 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 科凹 硬滑 大瓜 女瓜 女瓜 女瓜 女瓜 9 乌黑 稍蜷 流向 稍糊 科凹 硬滑 否 杏 白泽=? 坏瓜 女瓜 10 青绿 硬挺 清脆 模糊 平坦 較粘 杏 白黑 浅白 蜂鄉 平坦 較粘 12 浅白 白 推榜 浊响 横棚 四陷 否 一个 女瓜 女瓜<	编号	色泽	根蒂	敲声	纹理	脐部	触感	好瓜	
3 乌黑 蜷缩 浊响 清晰 凹陷 硬滑 是	1	青绿	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是	[纹理=?]
1	2	乌黑	蜷缩	沉闷	清晰	凹陷	硬滑	是	
5 浅白 蜷缩 浊响 清晰 凹陷 硬滑 是 6 青绿 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 是 7 乌黑 稍蜷 浊响 稍糊 稍凹 软粘 是 8 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 科凹 硬滑 否 9 乌黑 稍蜷 沉闷 稍糊 平坦 软粘 否 10 青绿 硬挺 清脆 清晰 平坦 软粘 否 11 浅白 砂挺 清脆 模糊 平坦 软粘 否 12 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 软粘 否 13 青绿 浊响 稍糊 凹陷 硬滑 否 14 浅白 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 否 15 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 否 16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑 否 16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑 否	3	乌黑	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是	清晰
6 青绿 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 是	4	青绿	蜷缩	沉闷	清晰	凹陷	硬滑	是	田菜 o
7 乌黑 稍蜷 浊响 稍糊 稍凹 软粘 是 8 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 硬滑 否 9 乌黑 稍蜷 沉闷 稍糊 稍凹 硬滑 否 10 青绿 硬挺 清脆 清晰 平坦 软粘 否 11 浅白 砂斑 清脆 模糊 平坦 软粘 否 12 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 软粘 否 13 青绿 浊响 稍糊 凹陷 硬滑 否 14 浅白 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 15 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑	5	浅白	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是	(根帝=?) 無恐=?
7 乌黑 梢蜷 浊响 梢树 梢凹 软粘 是 9 乌黑 梢蜷 浊响 清晰 梢凹 硬滑 是 9 乌黑 梢蜷 沉闷 梢糊 梢凹 硬滑 否 10 青绿 硬挺 清脆 清晰 平坦 软粘 否 11 浅白 硬挺 清脆 模糊 平坦 硬滑 否 12 浅白 蜷缩 浊响 模糊 凹陷 硬滑 否 14 浅白 稍蜷 沉闷 稍糊 凹陷 硬滑 否 14 浅白 稍蜷 沉闷 稍糊 凹陷 硬滑 否 15 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 否 16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑 否	6	青绿	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	软粘	是	
9 乌黑 稍蜷 沉闷 稍糊 稍凹 硬滑 否 10 青绿 硬挺 清脆 清晰 平坦 软粘 否 百 11 浅白 硬挺 清脆 模糊 平坦 硬滑 否 12 浅白 蜷缩 浊响 模糊 凹陷 硬滑 否 14 浅白 稍蜷 沉闷 稍糊 凹陷 硬滑 否 14 浅白 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 否 15 乌黑 稍蜷 浊响 檳糊 平坦 硬滑 否 16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑 否	7	乌黑	稍蜷	浊响	稍糊	稍凹	软粘	是	1月逝 以及 使用 1八和
10 青绿 硬挺 清脆 清晰 平坦 软粘 否 11 浅白 硬挺 清脆 模糊 平坦 硬滑 否 12 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 软粘 否 13 青绿 稍蜷 浊响 稍糊 凹陷 硬滑 否 14 浅白 稍蜷 沉闷 稍糊 凹陷 硬滑 否 15 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 否 16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑 否	8	乌黑	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	硬滑	是	→ 大爪 — — — — — — — — — — — — — — — — — —
11 浅白 硬挺 清脆 模糊 平坦 硬滑 否 12 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 软粘 否 13 青绿 稍蜷 浊响 稍糊 凹陷 硬滑 否 14 浅白 稍蜷 沉闷 稍糊 凹陷 硬滑 否 15 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑 否	9	乌黑	稍蜷	沉闷	稍糊	稍凹	硬滑	否	- サ (大) (L) (上) (大) (大) (大) (大) (大) (大) (大) (大) (大) (大
11 浅白 硬挺 清脆 模糊 平坦 硬滑 否 12 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 软粘 否 13 青绿 稍蜷 浊响 稍糊 凹陷 硬滑 否 14 浅白 稍蜷 沈闷 稍糊 凹陷 硬滑 否 15 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑 否	10	青绿	硬挺	清脆	清晰	平坦	软粘	否	青绿 乌黑 浅白
13 青绿 稍蜷 浊响 稍糊 凹陷 硬滑 否 14 浅白 稍蜷 沉闷 稍糊 凹陷 硬滑 否 15 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑 否	11	浅白	硬挺	清脆	模糊	平坦	硬滑	否	7/11
13 青绿 相蜷 短响 相树 凹陷 硬滑 否 14 浅白 稍蜷 沉闷 稍糊 凹陷 硬滑 否 15 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 否 16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑 否 好瓜 坏瓜	12	浅白	蜷缩	浊响	模糊	平坦	软粘	否	(好爪) (触咸=?) (好爪)
15 乌黑 稍蜷 浊响 清晰 稍凹 软粘 否 16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑 否 4 大瓜 大瓜 大瓜	13	青绿	稍蜷	浊响	稍糊	凹陷	硬滑	否	
16 浅白 蜷缩 浊响 模糊 平坦 硬滑 否 好瓜 坏瓜	14	浅白	稍蜷	沉闷	稍糊	凹陷	硬滑	否	硬滑/ 软粘
	15	乌黑	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	软粘	否	(17 m) (17 m)
17 青绿 蜷缩 沉闷 稍糊 稍凹 硬滑 否	16	浅白	蜷缩	浊响	模糊	平坦	硬滑	否	好瓜
	17	青绿	蜷缩	沉闷	稍糊	稍凹	硬滑	否	

决策树的优点以及相关算法

优点:

- 直观,具有很好的可解释性;
- 不需要任何先验假设。

发展历史及主要算法:

- 使决策树受到关注、成为机器学习主流技术的算法: ID3
- 最常用的决策树算法: C4.5
- 用于分类和回归任务的决策树算法: CART
- 基于决策树的最强大算法: RF (Random Forest)—集成学习

决策树构建基本步骤

给定待划分数据集D,以及待选择属性集A;

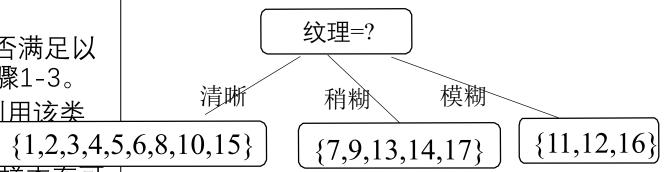
- 1.从待选择属性集里面选取一个最优属划分属性a
- 2.把属性a最为新的中间节点,其**每个可能的取值** a^v 对应一个新的分支,针对每个 a^v ,从D中找出对应的样本子集 D_{a^v} ;
- 3.把每个 D_{av} 作为D, 更新 $A \leftarrow A \setminus a$, 判断是否满足以下任一条件退出本次递归,不满足则重复步骤1-3。
 - a. 当前D中的所有样本属于同一个类,则且该类别标记为叶子节点; $\{1.2.3.4\}$
 - b. 当前待选属性集A为空或当前D包含的样本在可用属性集中所有属性的取值相同,则用D中出现最多的类别标记叶子节点;
 - c. 当前*D*为空集, 用其父节点中出现最多的类别标记叶子节点;

初始化:

 $D = \{1, 2, 3 \cdots 17\},\$

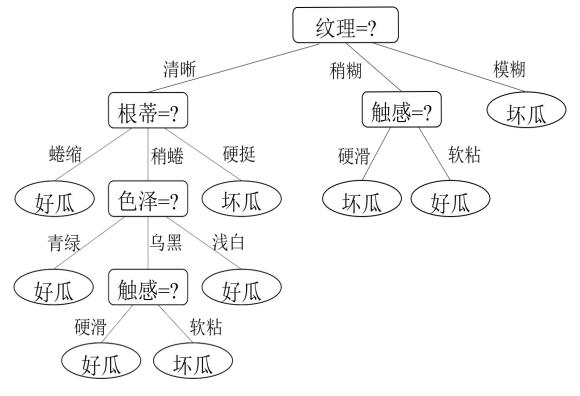
A={色泽、根蒂、敲声、纹理、脐部、触感}

假设"纹理"为当前A里面最优的划分属性 更新A={色泽、根蒂、敲声、脐部、触感}



D={1,2,3,4,5,6,8,10,15}不满足退出条件,继续选择划分属性"根蒂"进行生长

标出以下叶子节点分别属于哪类停止条件



/ / 位	上条件	•
门之工		•

- (1) 当前结点包含的样本全属于同一类别;
- (2) 当前属性集为空或当前节点包含的样本在可用属性集中所有属性的取值相同;
- (3) 当前结点包含的样本集合为空。

编号	色泽	根蒂	敲声	纹理	脐部	触感	好瓜
1	青绿	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是
2	乌黑	蜷缩	沉闷	清晰	凹陷	硬滑	是
3	乌黑	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是
4	青绿	蜷缩	沉闷	清晰	凹陷	硬滑	是
5	浅白	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是
6	青绿	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	软粘	是
7	乌黑	稍蜷	浊响	稍糊	稍凹	软粘	是
8	乌黑	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	硬滑	是
9	乌黑	稍蜷	沉闷	稍糊	稍凹	硬滑	否
10	青绿	硬挺	清脆	清晰	平坦	软粘	否
11	浅白	硬挺	清脆	模糊	平坦	硬滑	否
12	浅白	蜷缩	浊响	模糊	平坦	软粘	否
13	青绿	稍蜷	浊响	稍糊	凹陷	硬滑	否
14	浅白	稍蜷	沉闷	稍糊	凹陷	硬滑	否
15	乌黑	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	软粘	否
16	浅白	蜷缩	浊响	模糊	平坦	硬滑	否
17	青绿	蜷缩	沉闷	稍糊	稍凹	硬滑	否

决策树构造的核心问题: 如何选择划分属性?

策略: "分而治之" (divide-and-conquer)从根至叶的递归过程

在每个中间结点寻找一个"划分"(split or test)属性

关键: 寻找当前最具有辨别力 (discriminative) 的特征。

编号	色泽	敲声	好瓜
1	青绿	清脆	是
2	青绿	沉闷	是
3	乌黑	沉闷	是否
4	乌黑	清脆	否

哪个特征更有利于分类?

一个特征的每个取值对应的类别越纯则其辨别力越大

度量一: 信息增益 (information gain)

信息熵 (entropy) 是度量样本集合"纯度"最常用的一种指标。 假定当前样本集合 D 中第 k 类样本所占的比例为 p_k ,则 D 的信息熵定 义为:

$$\operatorname{Ent}(D) = -\sum_{k=1}^{|\mathcal{Y}|} p_k \log_2 p_k \qquad \qquad \text{计算信息熵时约定: 若}$$
 $p = 0$, 则 $p \log_2 p = 0$.

Ent(D) 的值越小,则 D 的纯度越高

Ent(D) 的最小值为 0, 最大值为 $log_2 |\mathcal{Y}|$.

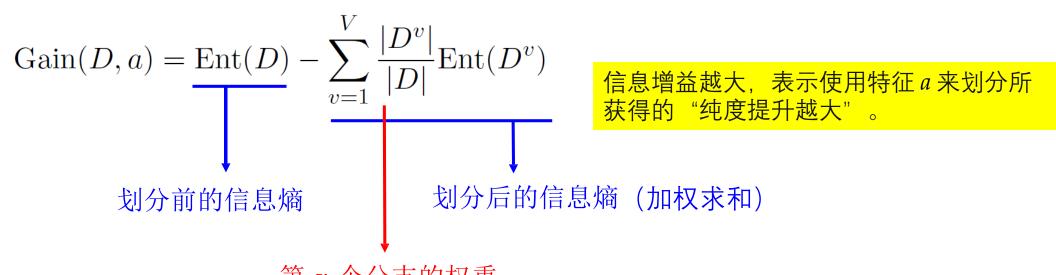
信息增益直接以信息熵为基础,计算当前划分对信息熵所造成的变化

度量一: 信息增益 (information gain)

离散属性 a 的取值: $\{a^1, a^2, \dots, a^V\}$

 D^v : D 中在 a 上取值 = a^v 的样本集合

以属性 a 对数据集 D 进行划分所获得的信息增益为: Gain(D,a) = Ent(D) - Ent(D,a)



第 v 个分支的权重, 样本越多越重要

ID3中用信息增益进行属性选择

一个例子

该数据集包含17个训练样例,属于2个 类别,即 $|\mathcal{Y}| = 2$, 其中正例占 $p_1 = \frac{8}{17}$, 反例占 $p_2 = \frac{9}{17}$,

则根结点的信息熵为

编号	色泽	根蒂	敲声	纹理	脐部	触感	好瓜
1	青绿	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是
2	乌黑	蜷缩	沉闷	清晰	凹陷	硬滑	是
3	乌黑	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是
4	青绿	蜷缩	沉闷	清晰	凹陷	硬滑	是
5	浅白	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是
6	青绿	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	软粘	是
7	乌黑	稍蜷	浊响	稍糊	稍凹	软粘	是
8	乌黑	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	硬滑	是
9	乌黑	稍蜷	沉闷	稍糊	稍凹	硬滑	否
10	青绿	硬挺	清脆	清晰	平坦	软粘	否
11	浅白	硬挺	清脆	模糊	平坦	硬滑	否
12	浅白	蜷缩	浊响	模糊	平坦	软粘	否
13	青绿	稍蜷	浊响	稍糊	凹陷	硬滑	否
14	浅白	稍蜷	沉闷	稍糊	凹陷	硬滑	否
15	乌黑	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	软粘	否
16	浅白	蜷缩	浊响	模糊	平坦	硬滑	否
17	青绿	蜷缩	沉闷	稍糊	稍凹	硬滑	否

$$\operatorname{Ent}(D) = -\sum_{k=1}^{2} p_k \log_2 p_k = -\left(\frac{8}{17} \log_2 \frac{8}{17} + \frac{9}{17} \log_2 \frac{9}{17}\right) = 0.998$$

一个例子(续)

- □ 以属性 "色泽"为例,其对应的3个数据子集分别为 D^1 (色泽=青绿), D^2 (色泽=乌黑), D^3 (色泽=浅白)。
- □ 子集 D^1 包含编号为 $\{1,4,6,10,13,17\}$ 的6 个样例,即 $|D^1|=6$,其中正例占 $p_1=\frac{3}{6}$,反例占 $p_2=\frac{3}{6}$, D^2 、 D^3 同理。3 个结点的信息熵为:

$$\operatorname{Ent}(D^{1}) = -\left(\frac{3}{6}\log_{2}\frac{3}{6} + \frac{3}{6}\log_{2}\frac{3}{6}\right) = 1.000$$

$$\operatorname{Ent}(D^{2}) = -\left(\frac{4}{6}\log_{2}\frac{4}{6} + \frac{2}{6}\log_{2}\frac{2}{6}\right) = 0.918$$

$$\operatorname{Ent}(D^{3}) = -\left(\frac{1}{5}\log_{2}\frac{1}{5} + \frac{4}{5}\log_{2}\frac{4}{5}\right) = 0.722$$

□属性"色泽"的信息增益为

Gain(D, 色泽) = Ent(D) -
$$\sum_{v=1}^{3} \frac{|D^v|}{|D|}$$
Ent(D^v)
= 0.998 - $(\frac{6}{17} \times 1.000 + \frac{6}{17} \times 0.918 + \frac{5}{17} \times 0.722)$
= 0.109

一个例子(续)

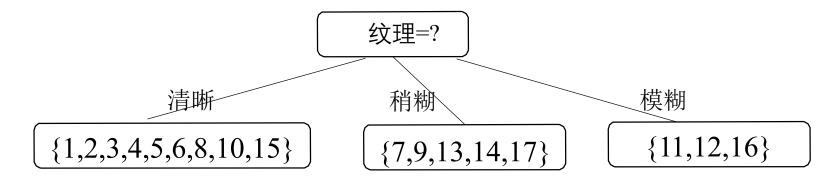
□ 类似的, 其他属性的信息增益为

$$Gain(D, 根蒂) = 0.143$$
 $Gain(D, 敲声) = 0.141$

$$Gain(D, 纹理) = 0.381$$
 $Gain(D, 脐部) = 0.289$

$$Gain(D, 触感) = 0.006$$

□ 显然,属性"纹理"的信息增益最大,其被选为当前划分属性



一个例子(续)

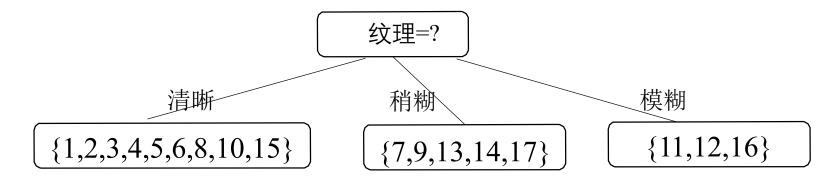
□ 类似的, 其他属性的信息增益为

$$Gain(D, 根蒂) = 0.143$$
 $Gain(D, 敲声) = 0.141$

$$Gain(D, 纹理) = 0.381$$
 $Gain(D, 脐部) = 0.289$

$$Gain(D, 触感) = 0.006$$

□ 显然,属性"纹理"的信息增益最大,其被选为当前划分属性



决策树构造的基本算法

```
输入: 训练集 D = \{(x_1, y_1), (x_2, y_2), \dots, (x_m, y_m)\};
     属性集 A = \{a_1, a_2, \dots, a_d\}.
过程: 函数 TreeGenerate(D, A)
1: 生成结点 node:
                                       递归返回,
  if D 中样本全属于同一类别 C then
                                       情形(1)
    将 node 标记为 C 类叶结点; return
 4 end if
5 if A = \emptyset OR D 中样本在 A 上取值相同 then
                                                                递归返回,
                                                                情形(2)
    将 node 标记为叶结点, 其类别标记为 D 中样本数最多的类; return
7 end if
8: 从A 中选择最优划分属性a_*;
9: for a<sub>*</sub> 的每一个值 a<sub>*</sub> do
     为 node 生成一个分支; 令 D_v, 表示 D 中在 a_* 上取值为 a_*^v 的样本子集;
10:
    if D_v 为空 then
                                                                   递归返回,
      将分支结点标记为叶结点, 其类别标记为 D 中样本最多的类; return
                                                                   情形(3)
    else
                                               D为D_v的父结点
       以 TreeGenerate(D_v, A \setminus \{a_*\}) 为分支结点
14:
    end if
15:
16: end for
                                 决策树算法的
输出: 以 node 为根结点的一棵决策树
                                     核心
```

度量二:增益率(gain ratio)

信息增益:对可取值数目较多的属性有所偏好

有明显弱点,例如:考虑将"编号"作为一个属性,因为"编号"的信息熵为0。

增益率:
$$Gain_ratio(D, a) = \frac{Gain(D, a)}{IV(a)}$$

C4.5算法中使用增益率

其中
$$IV(a) = -\sum_{v=1}^{V} \frac{|D^v|}{|D|} \log_2 \frac{|D^v|}{|D|}$$

属性 a 的可能取值数目越多 (即 V 越大),则 IV(a) 的值通常就越大

直接用增益率可能偏好取值个数少的属性。



启发式: 先从候选划分属性中找出信息增益高于平均水平的,再从中选取增益率最高的。

度量三: 基尼指数 (gini index)

$$Gini(D) = \sum_{k=1}^{|\mathcal{Y}|} \sum_{k' \neq k} p_k p_{k'}$$

反映了从 D 中随机抽取两个样例, | 其类别标记不一致的概率

$$=1-\sum_{k=1}^{|\mathcal{Y}|}p_k^2$$
.

 $=1-\sum_{k=1}^{|\mathcal{Y}|}p_k^2$. Gini(D) 越小,数据集 D 的纯度越高 当 $p_k = \frac{1}{|\mathcal{V}|}$ 时,Gini(D)最大,为1- $\frac{1}{|\mathcal{Y}|}$

总体趋势与信息熵类似。

属性
$$a$$
 的基尼指数: Gini_index $(D,a) = \sum_{v=1}^{V} \frac{|D^v|}{|D|}$ Gini (D^v)

在候选属性集合中,选取那个使划分后基尼指数最小的属性

剪枝

为了尽可能正确分类训练样本,有可能造成分支过多层数越深,节点对应的样本数目越少,很可能不具有统计意义

导致过拟合!

可通过主动去掉一些分支来降低过拟合的风险

基本策略:

- 预剪枝 (pre-pruning): 提前终止某些分支的生长
- 后剪枝 (post-pruning): 生成一棵完全树, 再"回头"剪枝

剪枝

研究表明: 划分选择的各种准则虽然对决策树的尺寸有较大影响,但对泛化性能的影响很有限。

例如信息增益与基尼指数产生的结果,仅在约2%的情况下不同

剪枝方法和程度对决策树泛化性能的影响更为显著

在数据带噪时甚至可能将泛化性能提升 25%

剪枝 (pruning) 是决策树对付"过拟合"的主要手段!

剪枝的基本思路:比较剪枝前后决策树的优劣-验证集的准确率。剪枝后错误率是否降低/准确率是否提高来决定是否剪枝

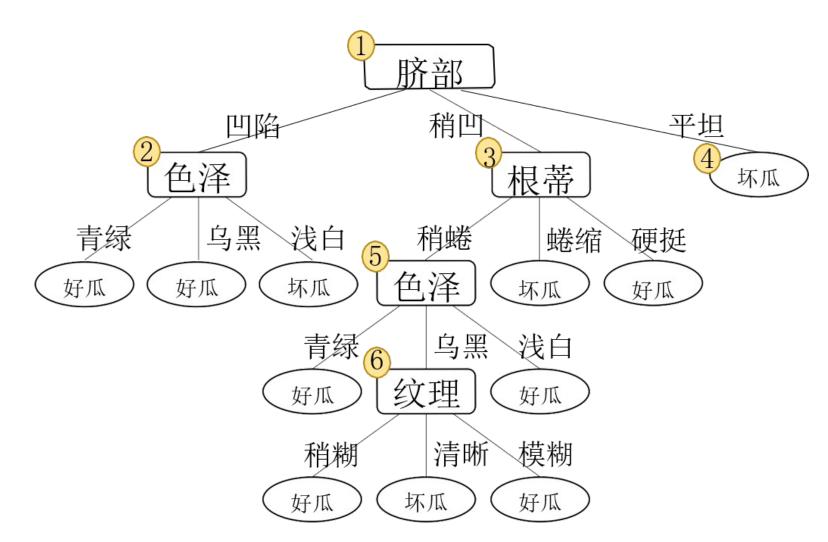
数据集

	编号	色泽	根蒂	敲声	纹理	脐部	触感	好瓜
٦	1	青绿	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是
	2	乌黑	蜷缩	沉闷	清晰	凹陷	硬滑	是
	3	乌黑	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是
	6	青绿	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	软粘	是
Уш <i>//-/- А</i>	7	乌黑	稍蜷	浊响	稍糊	稍凹	软粘	是
训练集	10	青绿	硬挺	清脆	清晰	平坦	软粘	否
	14	浅白	稍蜷	沉闷	稍糊	凹陷	硬滑	否
	15	乌黑	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	软粘	否
	16	浅白	蜷缩	浊响	模糊	平坦	硬滑	否
L	17	青绿	蜷缩	沉闷	稍糊	稍凹	硬滑	否
	编号	色泽	根蒂	敲声	纹理	脐部	触感	好瓜
٢	4	青绿	蜷缩	沉闷	清晰	凹陷	硬滑	是
	5	浅白	蜷缩	浊响	清晰	凹陷	硬滑	是
→ A > → A > .	8	乌黑	稍蜷	浊响	清晰	稍凹	硬滑	是
验证集	9	乌黑	稍蜷	沉闷	稍糊	稍凹	硬滑	否
	11	浅白	硬挺	清脆	模糊	平坦	硬滑	否
	12	浅白	蜷缩	浊响	模糊	平坦	软粘	否
L	13	青绿	稍蜷	浊响	稍糊	凹陷	硬滑	否

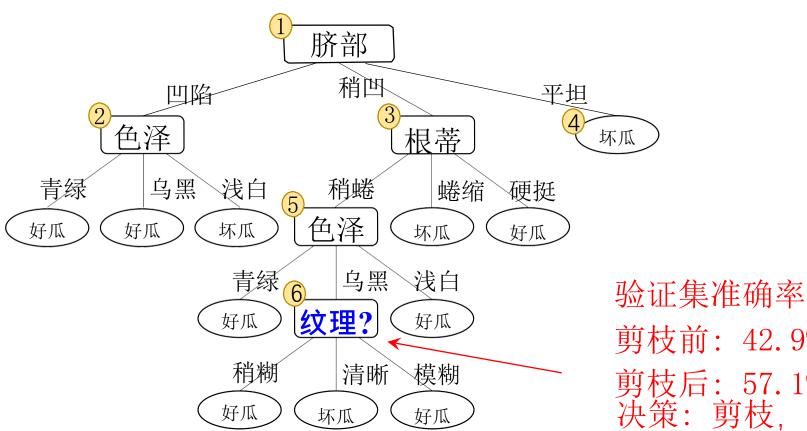
剪枝过程中需评估剪枝前后决策树的优劣, 现在我们假定使用"留出法"

方法一: 后剪枝

先生成一棵完整的决策树,其验证集准确率测得为 42.9%



自底向上。首先考虑结点⑥,若将其替换为叶结点,根据落在其上的训练样例 {7,15}将其标记为"好瓜",测得验证集准确率提高至 57.1%,于是决定剪枝

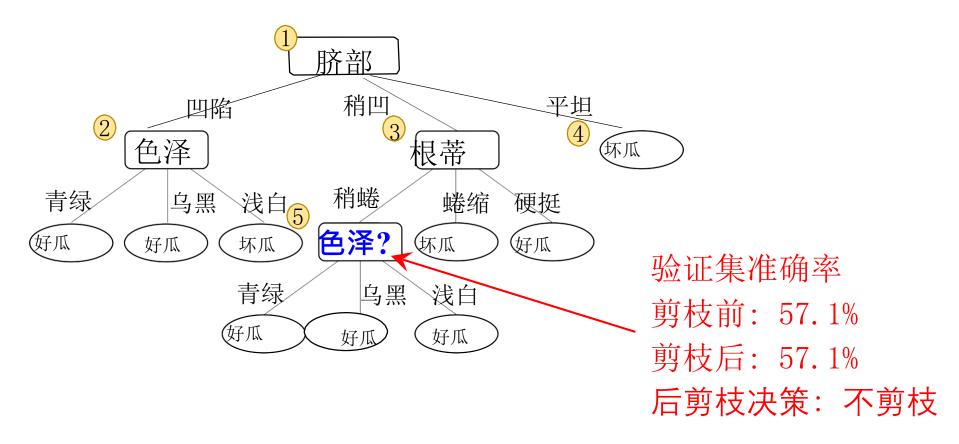


剪枝前: 42.9%

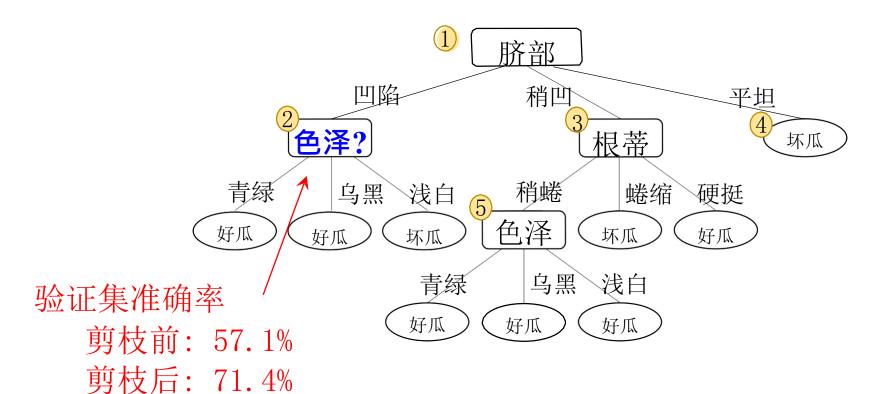
剪枝后: 57.1%

决策:剪枝,替换为叶子节点好瓜

然后考虑结点⑤,若将其替换为叶结点,根据落在其上的训练样例将其标记为"好瓜",测得验证集精度仍为 **57.1%**,可以不剪枝

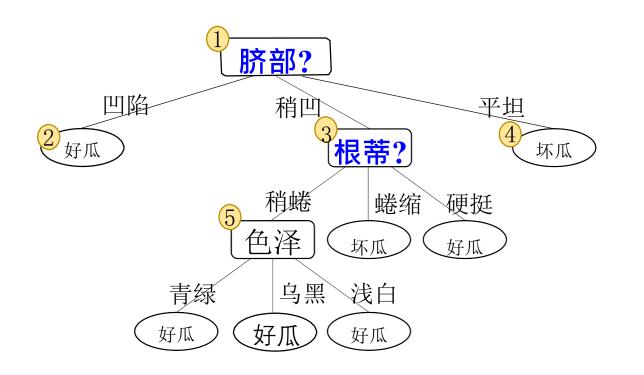


对结点②,若将其替换为叶结点,根据落在其上的训练样例{1,2,3,14},将其标记为"好瓜",测得验证集准确率提升至71.4%,决定剪枝。

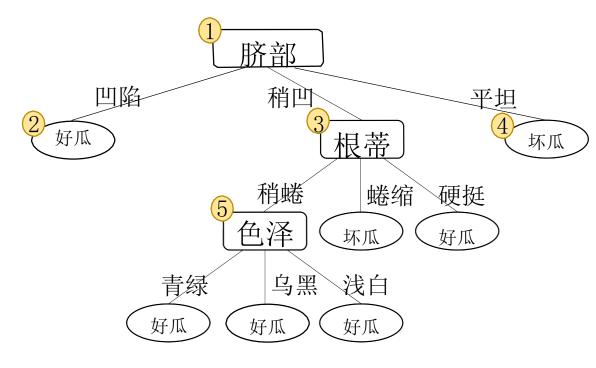


后剪枝决策:剪枝,替换为叶子节点好瓜

对节点 ③和 ①先后替换为叶结点,均未测得验证集准确率提升,于是不剪枝。



最终,后剪枝得到的决策树:



方法二:预剪枝(自顶向下)

	编号	色泽	根蒂	敲声	纹理	脐部	触感	好瓜
验	4 5 8	青绿 浅白 乌黑	蜷缩 蜷缩 稍蜷	沉闷 浊响 浊响	清晰 清晰 清晰	凹陷 凹陷 稍凹	硬滑 硬滑 硬滑	是是是
证集	9 11 12 13	乌黑 浅白 浅白 青绿	稍蜷 硬缩 鹅蜷	沉闷 清脆响 浊响	稍糊 模糊 模糊 稍糊	稍凹 平坦 平坦 凹陷	硬滑 硬滑 软粘 硬滑	否否否否

结点**1**: 若不划分,则将其标记为叶结点,类别标记为训练样例中最多的类别,若选"好瓜"。验证集中, $\{4, 5, 8\}$ 被分类正确,得到验证集准确率为 $\frac{3}{7} \times 100\% = 42.9\%$

① 「脐部=?」 ← 验证集准确率 "脐部=?" 划分前: 42.9%

预剪枝 (续)

	编号	色泽	根蒂	敲声	纹理	脐部	触感	好瓜
验	4 5 8	青绿 浅白 乌黑	蜷缩 蜷缩 稍蜷	沉闷 浊响 浊响	清晰 清晰 清晰	凹陷 凹陷 稍凹	硬滑 硬滑 硬滑	是是是
证集	9 11 12 13	乌黑 浅白	稍 梃 蜷 緩 緒 蜷	沉清 油 油 响	稍糊 模糊 模糊	稍凹 平坦 凹陷	硬滑 硬滑 软粘 硬	否否否否

结点1: 若划分,根据结点②③,④的训练样例,将这3个结点分别标记为"好瓜"、"好瓜"、

此时,验证集中编号为 $\{4, 5, 8, 11, 12\}$ 的样例被划分正确,验证集准确率为: $\frac{5}{7} \times 100\% = 71.4\%$

验证集准确率 "脐部=?" 划分前: 42.9%

划分后: 71.4%

预剪枝决策:划分

预剪枝(续)

	编号	色泽	根蒂	敲声	纹理	脐部	触感	好瓜
验	4 5 8	青绿 浅白 乌黑	蜷缩 蜷缩 稍蜷	沉闷 浊响 浊响	清晰清晰清晰	凹陷 凹陷 稍凹	硬滑 硬滑 硬滑	是 是 是
证 集	9 11 12 13	乌黑 浅白 浅白 青绿	稍 矮 矮 缩 稍 蜷	沉闷 清脆 浊响 浊响	稍糊 模糊 模糊 稍糊	稍凹 平坦 平坦 凹陷	硬滑 硬滑 软粘 硬滑	否否否否

对结点②,③,④ 分别进行剪枝判断,结点②和③都禁止划分,结点④本身为叶子结点。最终得到仅有一层划分的决策树。

验证集准确率

"色泽=?" 划分前: 71.4%

划分后: 57.1%

预剪枝决策:禁止划分

验证集准确率

"根蒂=?" 划分前: 71.4%

坏瓜

划分后: 71.4%

预剪枝决策:禁止划分

预剪枝 vs. 后剪枝

- □ 时间开销:
- 预剪枝: 训练时间开销降低, 测试时间开销降低
- 后剪枝: 训练时间开销增加, 测试时间开销降低
- □ 过/欠拟合风险:
- 预剪枝: 过拟合风险降低, 欠拟合风险增加
- 后剪枝: 过拟合风险降低, 欠拟合风险基本不变
- □ 泛化性能: 后剪枝通常优于预剪枝

剪枝评判标准:

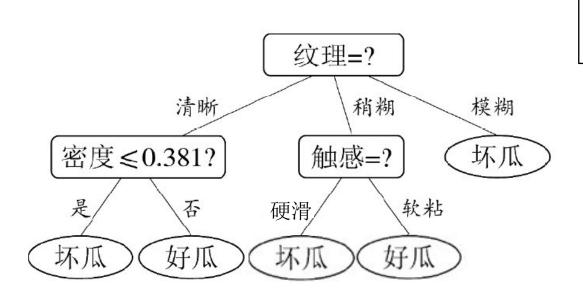
除了准确率,还可以同时考虑 模型的复杂度,比如树叶节点 的个数、对树编码需要的二进 位位数等。

连续属性

基本思路:连续属性离散化

常见做法:二分法 (bi-partition):一个连续属性转化成多个二值离散属性

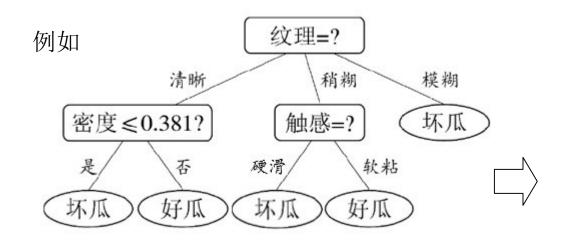
- 把n 个属性值排序,取相邻两个属性值的中间值作为候选划分点;
- 然后将每个候选划分点当做一个(二值)离散属性处理;



结论:一个连续属性转换成t个二值属性,t为候选划分点的个数。

从"树"到"规则"

- 一棵决策树对应于一个"规则集"
- 每个从根结点到叶结点的分支路径对应于一条规则



- IF (纹理=清晰) ∧ (密度≤0.381) THEN 坏瓜
- IF (纹理=清晰) ^ (密度>0.381) THEN 好瓜
- IF (纹理=稍糊) ^ (触感=硬滑) THEN 坏瓜
- IF (纹理=稍糊) ^ (触感=软粘) THEN 好瓜
- IF (纹理=模糊) THEN 坏瓜

好处:

- □改善可理解性
- □进一步提升泛化能力

由于转化过程中通常会进行前件合并、泛化等操作例如 C4.5Rule 的泛化能力通常优于 C4.5决策树