

Práctica 1: Descenso por gradiente

Gonzalo A. Aranda Corral

19 de octubre de 2018

El objetivo principal de esta práctica es, por un lado, implementar varios métodos de regresión lineal y, por otro, hacer un primer acercamiento al tratamiento de datos.

Para poder realizarla, pondremos en la plataforma de la asignatura varios conjuntos de datos disponibles para descargarlos y los apuntes de teoría para usarlos de referencia.

1. Regresión lineal con una variable (atributo)

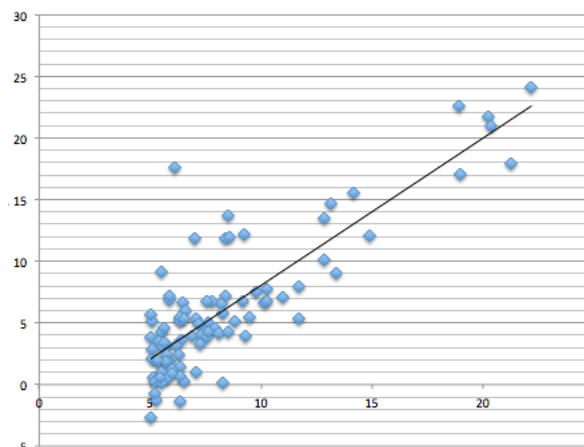
El primer problema que se plantea es la predicción de las ganancias de un restaurantes en función a la población de la ciudad donde está instalado.

El gerente de un restaurante francés está considerando diferentes ciudades para abrir un nuevo establecimiento y nos ha solicitado que le ayudemos a tomar la decisión para su localización. Para ello contamos con datos de varias ciudades y beneficios de los restaurantes de las mismas, en el fichero `regresion_1.csv`, donde la primera columna es la población de la ciudad y la segunda columna son los beneficios de los restaurantes en esa ciudad.

1.1. Pintando los datos

Es muy recomendable que la primera tarea que debemos de realizar cuando atacamos un conjunto de datos nuevos es su representación gráfica y así hacernos una idea, si es posible, de qué método sería el más adecuado para iniciar el análisis.

Para este conjunto de datos es bastante simple realizar un gráfico 2-D donde representemos los beneficios en función de la población.



Ejercicio 1 *Representar gráficamente los datos del fichero.*

Como primera estrategia, vamos a aplicar regresión lineal a esos datos.

1.2. Aplicación Externa

El objetivo principal es analizar los datos y para ello debemos de realizarlo de la forma más adecuada posible, usando todas las herramientas a nuestro alcance, tanto existentes como programarlas específicamente para nosotros.

Como primera aproximación podríamos usar una herramienta externa, o alguna librería existente, para hallar los datos que necesitamos o, al menos, una primera aproximación. En nuestro caso, el problema de regresión lineal es bastante simple y viene implementado en la mayoría de herramientas de tratamiento de datos, por lo que no será difícil extraer los valores de los coeficientes de ajuste.

Ejercicio 2 *Averiguar, mediante aplicación externa o librería, los valores de los coeficientes de ajuste.*

1.3. Ecuaciones normales

Comenzando con nuestro desarrollo, lo primero, más rápido y fiable, será aplicar la definición analítica obtenida en teoría.

$$\vec{\theta} = (X^T X)^{-1} X^T \vec{y}$$

Ejercicio 3 *Haciendo uso de alguna librería de matrices, calcular el valor de los coeficientes de ajuste y compararlos con los anteriores.*

1.4. Descenso por gradiente

En algunos casos se puede hacer necesaria la utilización de métodos alternativos. Una buena opción suele ser algún tipo de algoritmo por aproximaciones sucesivas y, para ello, vamos a implementar el algoritmo de *descenso por gradiente* y tratar de hallar los valores adecuados de θ de nuestros datos. Para verificar que nuestro algoritmo está realizando los cálculos de forma adecuada, iremos calculando y almacenando los valores que toma $J(\theta)$ en cada una de las iteraciones.

En nuestro caso, el criterio de convergencia va a ser un número fijo de iteraciones, que deberéis de ajustar en función del comportamiento del algoritmo.

El parámetro α de la actualización (velocidad de descenso) lo deberíamos de dividir por m (número de ejemplos del dataset) para trabajar sobre error relativo, ya que la cantidad del error absoluto puede generar algún tipo de *overflow*. Esto no tiene un significado teórico especial, pero ayuda a la convergencia más rápida.

Los valores iniciales de θ es un vector con todos sus componentes a “random”.

Ejercicio 4 *Escribir el algoritmo.*

Ejercicio 5 *Escribir los coeficientes de ajuste.*

1.5. Descenso por gradiente estocástico

El número de operaciones realizadas en el algoritmo anterior es bastante elevada, por lo que se hace necesaria algún tipo de aproximación. Esto da lugar al algoritmo de *Descenso por gradiente estocástico*.

Ejercicio 6 *Reescribir el algoritmo anterior, modificandolo para que admita “batch”s de cualquier tamaño.*

Ejercicio 7 *Escribir los nuevos coeficientes de ajuste.*

1.6. Predicción

Como resultado final ibamos buscando la predicción de beneficios en función de la población. Para ello

Ejercicio 8 *construiremos una función genérica que reciba como parámetros los coeficientes de ajuste y los valores de la entrada, generando el valor predecido*

Para hacernos una idea gráfica de los resultados,

Ejercicio 9 *Representar los datos junto con la gráfica de la hipótesis, para cada uno de los casos: Ec. normales, gradiente y gradiente estocástico.*

También es importante la idea numérica:

Ejercicio 10 *¿Cuánto beneficio obtendría un restaurante en una población estimada de 9.5 (miles) de habitantes?*

2. Regresión multidimensional.

La regresión multidimensional, en la teoría, no se diferencia en nada con la lineal simple, por lo que todos los algoritmos y funciones desarrolladas anteriormente deberían de seguir siendo válidos en multidimensionalidad.

Planteamos ahora el caso de predecir las ventas a partir de datos de TV, Radio y Periódicos. Usaremos el fichero `regresion_2.csv` que contiene toda la información necesaria y donde la última columna es la columna objetivo.

Ejercicio 11 *Repetir el cálculo de los coeficientes de ajustes para este nuevo problema, usando las mismas versiones anteriores de los algoritmos para:*

- *Librería o aplicación externa*
- *Ecuaciones normales*
- *Descenso por gradiente*
- *Descenso por gradiente estocástico*

Ejercicio 12 *Mostrar el tiempo de ejecución para cada una de las versiones.*