Python 與監督式學習 David Chiu 2016/03/19

機器學習 (Machine Learning)

電腦產生預測



預測分析

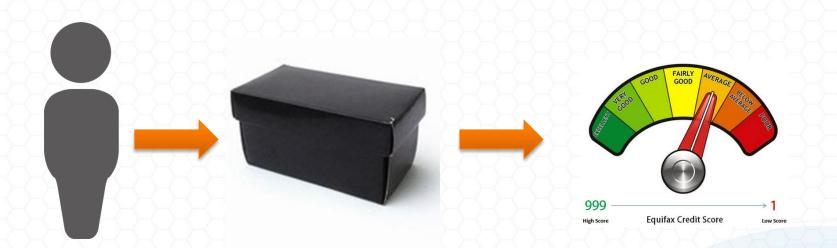
- 預測分析 (Predictive Analysis)
 - □從經驗中學習,預測個人未來行為已便做出更佳決定
- ■要預測什麼?
 - □個人或特定行為 (例如:行動、事件或發生狀況)
 - □ e.g. 每位顧客最可能點擊哪則廣告?
- ■要做什麼用?
 - □ 根據預測所做的決定,組織回應各項預測,或從預測 得知應採取行動
 - □ e.g. 依據點擊可能性及廣告商每次點擊的付費金額, 秀出效益最佳的廣告

預測可能得到出乎意料的結論

- ■買尿布的顧客也有可能會買啤酒
 - □因為大部分是男性去買的?
- ■上網查費率方案的用戶容易更換手機業者
 - □因為客戶提前解約有違約金要付,所以會先觀看費率,提醒自己何時該更改費率或業者?
- 同個朋友圈的人都會用同一家手機電信公司(社交 效應)
 - □若意見領袖更換手機電信業者,他的朋友們更換業者 的機率高達七倍
 - □受到網內互打的省錢方案影響?

預測模型

■ 根據個人行為的特定機制 (是否點擊廣告),預測模型把個人特性(身高,性別,職業)當輸入資料,提供預測分數當產出資料,分數越高,產生該行為的機會越高。



簡單的預測模型

- ■線性模型
 - □e.g. 針對一個化妝品廣告,對女性的吸引力可以給予權重90%,男性權重只有10%,以權重搭配個人點擊機率 (15%)可以算出對該用戶推薦的分數(或機率)
 - ⇒女性13.5%,男性1.5%
- ■規則模型
 - □e.g.
 - ▶假使使用者為女性
 - ▶而且月收入高達3萬以上
 - ▶而且還沒看過這廣告
 - ▶點擊機率為11%

機器學習

- ■機器學習的目的是:歸納(Induction)
 - □從詳細事實到一般通論

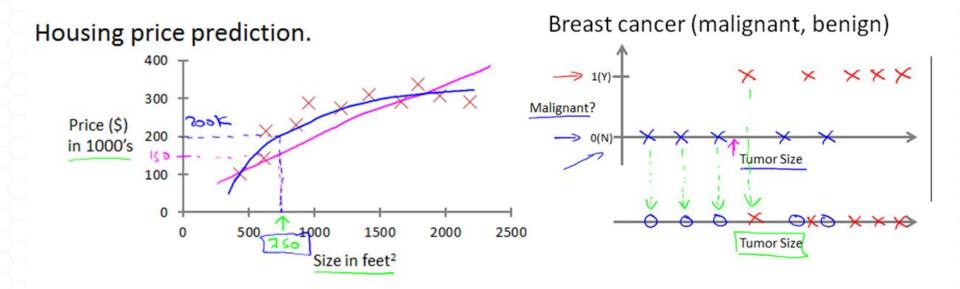
A computer program is said to learn from experience E with respect to some task T and some performance measure P, if its performance on T, as measured by P, improves with experience E

- -- Tom Mitchell (1998)
- ■找出有效的預測模型
 - □一開始都從一個簡單的模型開始
 - □藉由不斷餵入訓練資料,修改模型
 - □不斷提升預測績效

機器學習問題分類

- 監督式學習 (Supervised Learning)
 - □迴歸分析 (Regression)
 - □分類問題 (Classification)
- ■非監督式學習 (Unsupervised Learning)
 - □降低維度 (Dimension Reduction)
 - □分群問題 (Clustering)

監督式學習



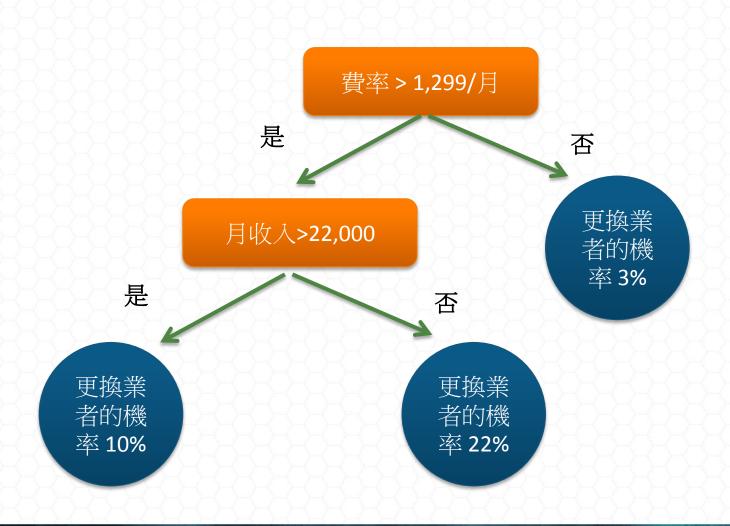
監督式學習

- ■分類問題
 - □根據已知標籤的訓練資料集(Training Set),產生一個新模型,用以預測測試資料集(Testing Set)的標籤。
 - □e.g. 股市漲跌預測
- ■迴歸分析
 - □使用一組<u>已知對應值</u>的數據產生的模型,預測新數據 的對應值
 - □e.g. 股價預測

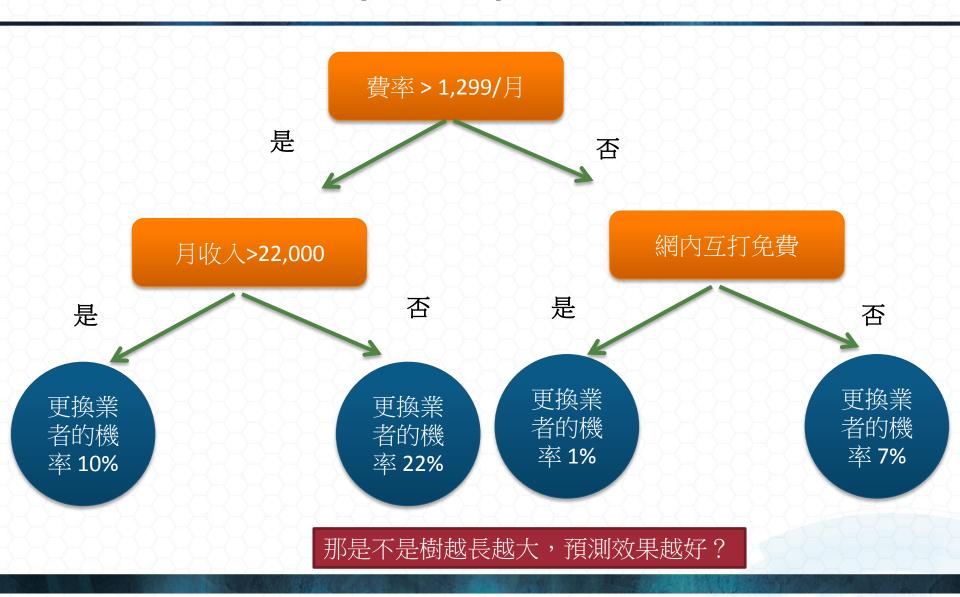
簡單的分類問題(決策樹)



簡單的分類問題(決策樹)



簡單的分類問題(決策樹)

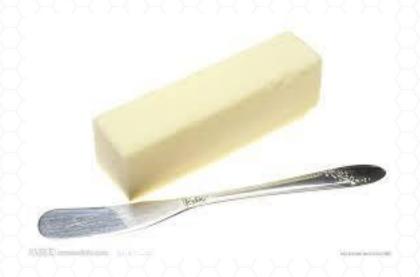


預測績效

- 增益值 (Lift)
 - □當預測績效越好,所要的成本越高,報酬遞減
- ■決策越多種類,要設計留住客戶的行銷策略是否 越多?
 - □為不同客戶種類 (Persona) 設計行銷策略
 - □4種通路的行銷成本,效益多高?
 - □20種通路的行銷成本,效益多高?

過度學習

■奶油生產速度可以預測標普500的收盤價?



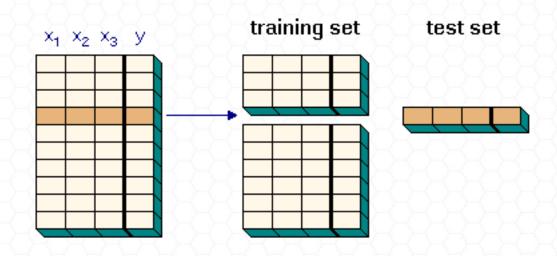


過度學習

- ■誤把雜訊當資訊
 - □過度假設
 - □過度解讀
 - □無法找出資料背後的事實
- 過度學習所得到的規則並非通則,只能應用於個案
 - □死記答案 v.s. 掌握原則

測試模型

使用外部資料或是一部分的內部資料來測試資料





NUMPY

- ■提供了快速的多維數組處理的能力
- 將常用的數學函數都進行數組化,使得這些數學 函數能夠直接對數組進行操作

■讓Python 可以像Matlab 一樣操作資料



引用 NUMPY

import numpy
numpy.version.full_version

使用array

import numpy as np a = np.array([0,1,2,3,4,5]) print a, a.ndim, a.shape

轉為二維陣列

b = a.reshape((3,2)) print b, b.ndim, b.shape

會指到同樣的位址

b[1][0] = 77 print b print a

使用copy

```
c = a.reshape((3,2)).copy()
print c
c[0][0] = -99
print a
print c
```

對數組進行操作

print a *2 print a **2

b = [1,2,3,4,5] print b * 2 print b ** 2

資料篩選

a[np.array([2,3,4])]

print a > 4print a[a>4]a[a>4] = 4print a

a.clip(0,4)

去除NAN

```
c = np.array([1,2,np.NAN, 3, 4])
print c
print np.isnan(c)
print c[-np.isnan(c)]
print np.mean(c[-np.isnan(c)])
```

可放入不同物件

```
np.array([1,"string"])
np.array([1,"string", set([1,2,3])])
```



SCIPY

■ SciPy在NumPy基礎上添加了眾多的科學計算所 需的各種套件

■可以讓Python 像 Matlab 一樣進行基本的機器學習



引用 SCIPY

import scipy scipy.version.version

線性迴歸

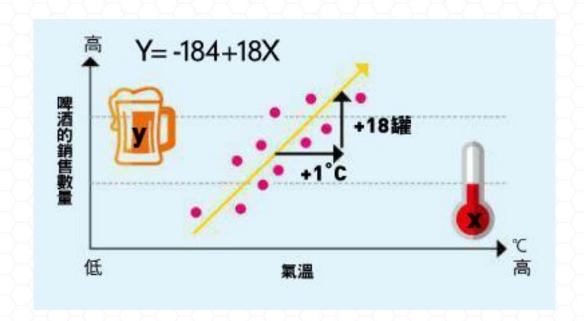
■ 線性迴歸是研究單一依變項(dependent variable) 與一個或以上自變項(independent variable)之間 的關係

- ■線性迴歸有兩個主要用處:
 - □預測指的是用已觀察的變數來預測依變項
 - □因果分析則是將自變項當作是依變項發生的原因

簡單線性迴歸

■數學模型

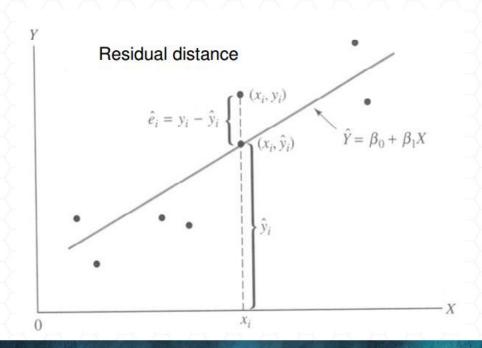
- $\square y = \beta_1 x + \beta_0 + \epsilon$
- □y 是依變數
- ■x是自變數
- □bi 是迴歸係數
- □bo是截距
- □←是誤差



最小平方估計法 - OLS

- ■找出殘差平方和最小的一條線

 - ■殘差平方和 $SSE = \sum_{i=1}^{n} (y_i \hat{y_i})^2$



計算迴歸係數

Х	Υ
(kilos)	(cost, \$)
17	132
21	150
35	160
39	162
50	149
65	170

■計算兩變數之間的迴歸係數

$$> X = c(17, 21, 35, 39, 50, 65)$$

$$> Y = c(132, 150, 160, 162, 149, 170)$$

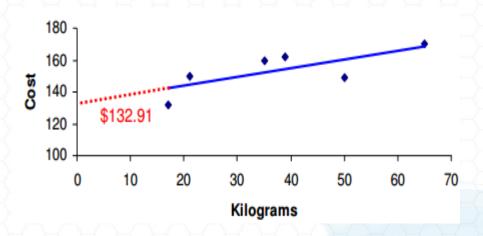
$$\hat{\beta}_1 = \frac{\sum XY - n\overline{X}\overline{Y}}{\sum X^2 - n\overline{X}^2}$$

計算截距

■計算截距

$$\hat{\beta}_{0} = \overline{y} - \hat{\beta}_{1} \overline{x}$$

- > B0 = Y_avg B1 * X_avg
- 得到迴歸公式 y = 0.553x + 132.91



讀入網頁流量數據

import os
import scipy as sp
import matplotlib.pyplot as plt

data = sp.genfromtxt("web_traffic.tsv",
delimiter="\t")
print(data[:10])

檢視資料

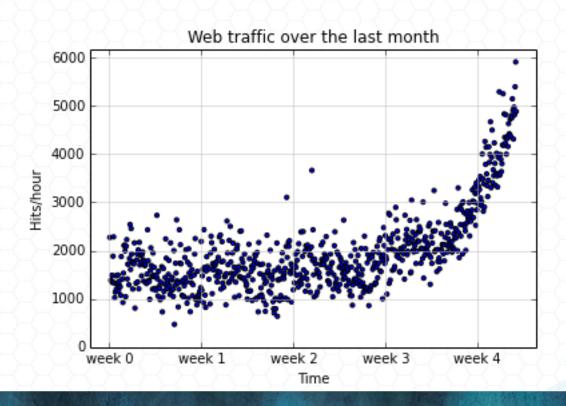
```
# fix invalid entries
x = data[:, 0]
y = data[:, 1]
print("Number of invalid entries:",
sp.sum(sp.isnan(y)))
x = x[~sp.isnan(y)]
y = y[~sp.isnan(y)]
```

指定繪圖函式

```
def plot_models(x, y, models, mx=None, ymax=None, xmin=None):
  plt.clf()
  plt.scatter(x, y, s=10)
  plt.title("Web traffic over the last month")
  plt.xlabel("Time")
  plt.ylabel("Hits/hour")
  plt.xticks(
     [w * 7 * 24 for w in range(10)], ['week %i' % w for w in range(10)])
  if models:
     if mx is None:
        mx = sp.linspace(0, x[-1], 1000)
     for model, style, color in zip(models, linestyles, colors):
        # print "Model:", model
       # print "Coeffs:", model.coeffs
        plt.plot(mx, model(mx), linestyle=style, linewidth=2, c=color)
     plt.legend(["d=%i" % m.order for m in models], loc="upper left")
  plt.autoscale(tight=True)
  plt.ylim(ymin=0)
  if ymax:
     plt.ylim(ymax=ymax)
  if xmin:
     plt.xlim(xmin=xmin)
  plt.grid(True, linestyle='-', color='0.75')
```



first look at the data
plot_models(x, y, None)



R Square

- 為相關係數(correlation)的平方值,其值介於0與1 之間
 - ■R Square越接近1,表示自變數與依變數相關性越高
 - □越接近0,表示自變數與依變數相關性越低
 - □迴歸可以解釋的變異比例,可作為自變數預測依變數 準確度的指標

模型評估

- Relative Mean Square Error
 - ■評估使用同單位的模型

$$RMSE = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^{n} (p_i - a_i)^2}{n}}$$

- Relative Square Error
 - ■評估使用不同單位的模型

$$RSE = \frac{\sum_{i=1}^{n} (p_i - a_i)^2}{\sum_{i=1}^{n} (\overline{a} - a_i)^2}$$

R Square

■ 迴歸可以解釋的變異比例,可作為自變數預測依 變數準確度的指標

Coefficient of Deternination
$$\rightarrow$$
 $R^2 = \frac{SSR}{SST} = 1 - \frac{SSE}{SST}$

Sum of Squares Total \rightarrow $SST = \sum (y - \bar{y})^2$

Sum of Squares Regression \rightarrow $SSR = \sum (y' - \bar{y}')^2$

Sum of Squares Error \rightarrow $SSE = \sum (y - y')^2$

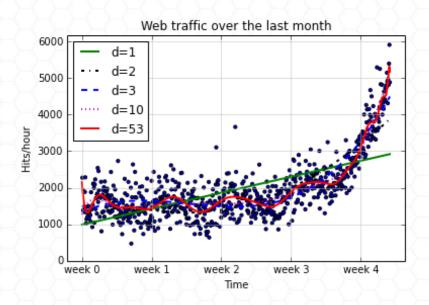
計算error rate 及模型參數

```
# obtain model parameter and error rate
fp1, res, rank, sv, rcond = sp.polyfit(x, y, 1,
full=True)
print("Model parameters: %s" % fp1)
print("Error of the model:", res)
```

繪圖

```
# plot data with different polyfit
f1 = sp.poly1d(fp1)
f2 = sp.poly1d(sp.polyfit(x, y, 2))
f3 = sp.poly1d(sp.polyfit(x, y, 3))
f10 = sp.poly1d(sp.polyfit(x, y, 10))
f100 = sp.poly1d(sp.polyfit(x, y, 100))
```

plot_models(x, y, [f1]) plot_models(x, y, [f1, f2]) plot_models(x, y, [f1, f2, f3, f10, f100])



考量轉折點

```
# using inflection point for plotting
inflection = 3.5 * 7 * 24
xa = x[:inflection]
ya = y[:inflection]
xb = x[inflection:]
yb = y[inflection:]
fa = sp.poly1d(sp.polyfit(xa, ya, 1))
fb = sp.poly1d(sp.polyfit(xb, yb, 1))
plot_models(x, y, [fa, fb])
```

SCIKIT LEARN

Scikit learn



Classification

Identifying to which set of categories a new observation belong to.

Applications: Spam detection, Image

recognition.

Algorithms: SVM, nearest neighbors, random forest. ... — Examples

Regression

Predicting a continuous value for a new example.

Applications: Drug response, Stock prices.
Algorithms: SVR, ridge regression, Lasso, ...

Examples

Clustering

Automatic grouping of similar objects into sets.

Applications: Customer segmentation, Grouping experiment outcomes

Algorithms: k-Means, spectral clustering,

mean-shift, ... — Examples

Dimensionality reduction

Reducing the number of random variables to

Model selection

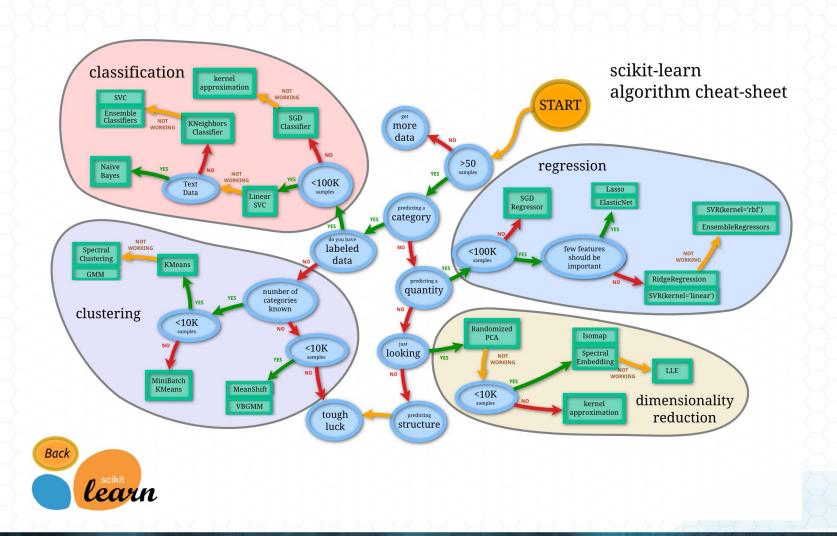
Comparing, validating and choosing

Preprocessing

Feature extraction and normalization.

_ TableauDesktop-6....exe

學習地圖



Estimators

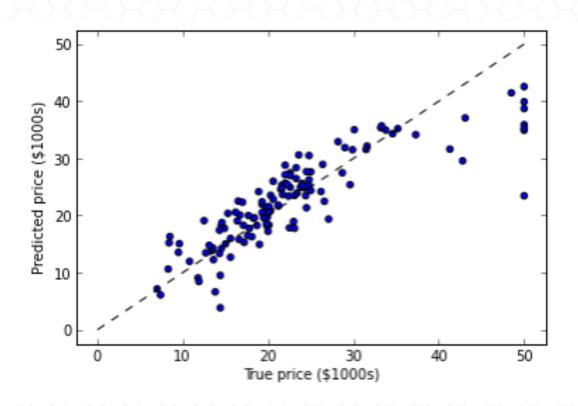
- ■可以藉由學習訓練資料集的屬性產生預測能力
- ■使用於分類演算法或是回歸分析
- 所有estimators 都有實現fit 函式:
 - □estimator.fit(X, y)

引用scikit learn

Quick example of building an estimator
from sklearn.linear_model import LinearRegression
model = LinearRegression(normalize=True) # Can set estimator's
parameter while instantiated
print model.normalize
print model

回歸分析 - 預測房價

使用回歸分析預測波士頓房價

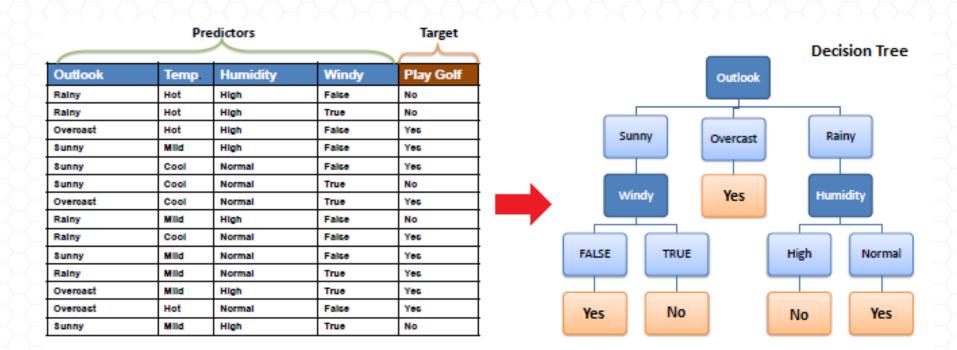


讀取內部資料集

```
# A sample code to get dataset from scikit-learn
from sklearn import datasets
# Load Dataset iris
iris = datasets.load_iris()
iris.data[1:5], iris.target[1:5]
```

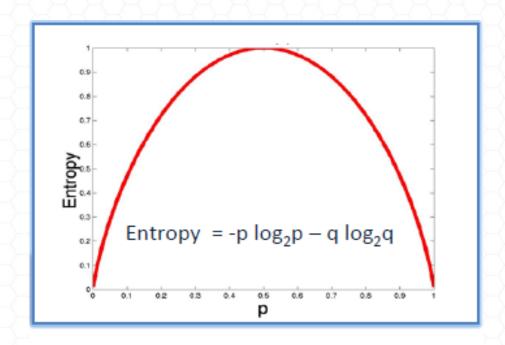
決策樹分類

決策樹



Entropy

■ 用於計算一個系統中的失序現象,也就是計算該 系統混亂的程度



Entropy = $-0.5 \log_2 0.5 - 0.5 \log_2 0.5 = 1$

單一變數的計算

$$E(S) = \sum_{i=1}^{c} -p_i \log_2 p_i$$

Play Golf		
Yes	No	
9	5	
	1	

Entropy(PlayGolf) = Entropy (5,9)

= Entropy (0.36, 0.64)

= - (0.36 log₂ 0.36) - (0.64 log₂ 0.64)

= 0.94

多變數的計算

= 0.693

$$E(T, X) = \sum_{c \in X} P(c)E(c)$$

		Play Golf		
		Yes	No	
Outlook	Sunny	3	2	5
	Overcast	4	0	4
	Rainy	2	3	5
				14



$$\mathbf{E}(PlayGolf, Outlook) = \mathbf{P}(Sunny)^*\mathbf{E}(3,2) + \mathbf{P}(Overcast)^*\mathbf{E}(4,0) + \mathbf{P}(Rainy)^*\mathbf{E}(2,3)$$

= $(5/14)^*0.971 + (4/14)^*0.0 + (5/14)^*0.971$

Information Gain

- 根據分割(Split)後,所減少的Entropy
- 因此做分割時,會尋找最大的Information Gain

1. 計算Entropy

```
Entropy(PlayGolf) = Entropy (5,9)

= Entropy (0.36, 0.64)

= - (0.36 log<sub>2</sub> 0.36) - (0.64 log<sub>2</sub> 0.64)

= 0.94
```

計算Information Gain

		Play Golf	
		Yes	No
Outlook	Sunny	3	2
	Overcast	4	0
	Rainy	2	3
Gain = 0.247			

		Play Golf	
		Yes	No
Temp.	Hot	2	2
	Mild	4	2
	Cool	3	1
Gain = 0.029			

		Play Golf	
		Yes	No
Humidity	High	3	4
	Normal	6	1
Gain = 0.152			

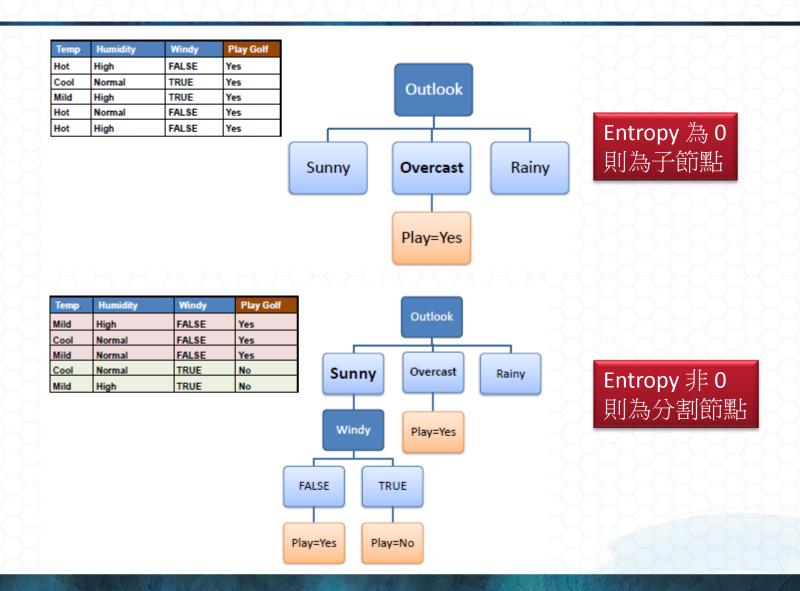
		Play Golf	
		Yes	No
Windy	False	6	2
	True	3	3
Gain = 0.048			

$$Gain(T, X) = Entropy(T) - Entropy(T, X)$$

選擇有最大Information Gain的屬性

*		Play Golf	
		Yes	No
Outlook	Sunny	3	2
	Overcast	4	0
	Rainy	2	3
Gain = 0.247			

選擇子節點與分割節點



決策樹如同IF...ELSE

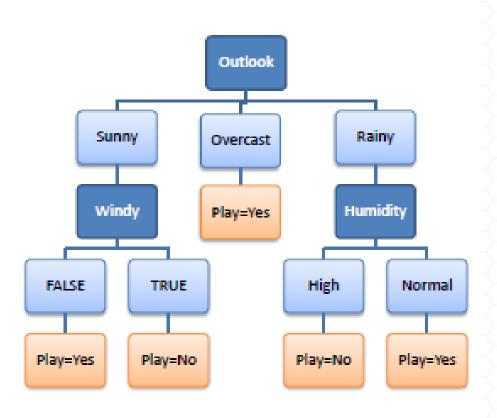
R₁: IF (Outlook=Sunny) AND (Windy=FALSE) THEN Play=Yes

R₂: IF (Outlook=Sunny) AND (Windy=TRUE) THEN Play=No

R₃: IF (Outlook=Overcast) THEN Play=Yes

R₄: IF (Outlook=Rainy) AND (Humidity=High) THEN Play=No

R_s: IF (Outlook=Rain) AND (Humidity=Normal) THEN Play=Yes



分類問題 - 分類花種

- ■以Sepal.Length, Sepal.Width, Petal.Length, Petal.Width 預測花種
- Iris 資料集
 - http://en.wikipedia.org/wiki/Iris_flower_data_set



Iris setosa



Iris versicolor



Iris virginica

使用決策樹分類

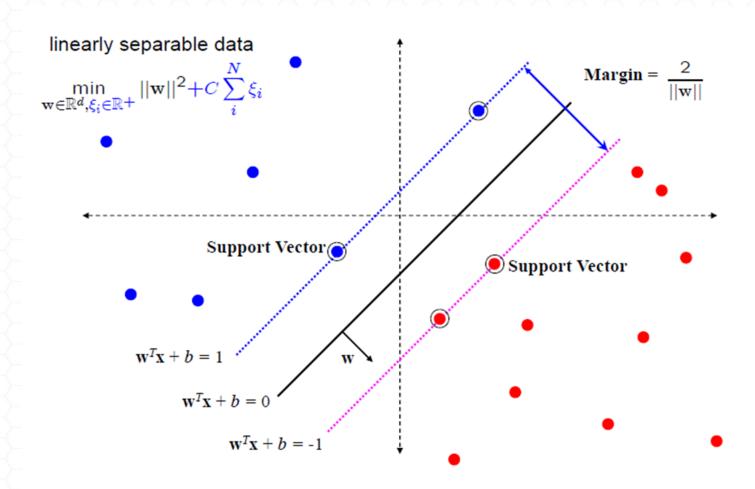
```
from sklearn.datasets import load_iris
from sklearn import tree
iris = load_iris()
clf = tree.DecisionTreeClassifier()
clf = clf.fit(iris.data, iris.target)
```

繪製Decision Tree

```
from IPython.display import Image
dot_data = StringIO()
tree.export_graphviz(clf, out_file=dot_data,
            feature_names=iris.feature_names,
            class_names=iris.target_names,
            filled=True, rounded=True,
            special_characters=True)
graph = pydot.graph_from_dot_data(dot_data.getvalue())
Image(graph.create_png())
```

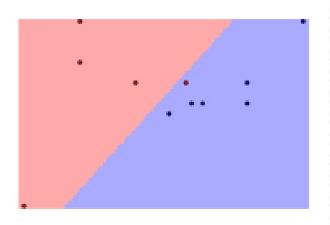
SVM 分類器

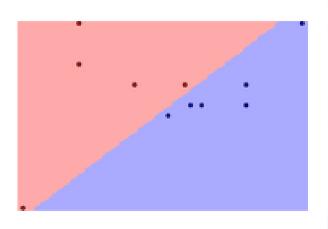
SVM 分類器



選擇SVM 的 Cost

- Cost 大小會決定該分類的 容忍度
 - □+C 越小代表可以忽略限制
 - →寬邊際
 - □+C越大代表無法忽略邊界
 - →窄邊際

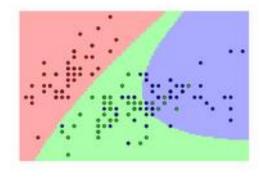


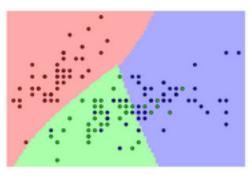


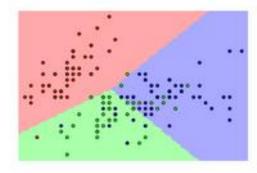
SVM Kernel

■ 選擇不同Kernel 時,執行速度不同,分類結果也不同









評估分類結果

進行交叉驗證

■ Holdout 驗證

隨機從最初的樣本中選出部分,形成交叉驗證數據,而剩餘的就當做訓練數據。一般來說,少於原本樣本三分之一的數據被選做驗證數據

■ K-fold cross-validation

K次交叉驗證,初始採樣分割成K個子樣本,一個單獨的子樣本被保留作為驗證模型的數據,其他K-1個樣本用來訓練。交叉驗證重複K次

■ 留一驗證

正如名稱所建議,留一驗證(LOOCV)意指只使用原本樣本中的一項來當做驗證資料,而剩餘的則留下來當做訓練資料

評估結果

■ True positive : 代表檢測出有,且實際上有的狀況

■ False positive:代表檢測出有,而實際上沒有的狀況

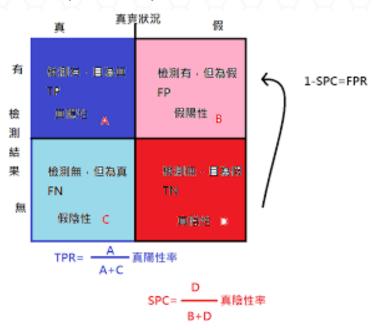
■ True negative:代表檢測出無,且實際上無的狀況

■ False negative:代表檢測出無,而實際上有的狀況

	真	狀況假
有	檢測有·且為真 TP	檢測有・但為假 FP
檢	真陽性	假陽性
測		
結		
果	檢測無・但為真	檢測無・且為假
	FN	TN
無	假陰性	真陰性

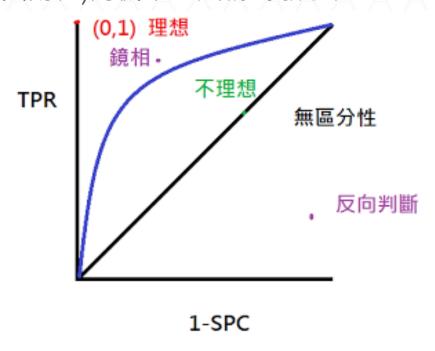
評估結果(續)

- True positive rate:代表所有陽性樣本中,得以正確檢測出陽性結果的機率,以TP/(TP+FN)計算,又稱為靈敏度(sensitivity)。
- True negative rate,代表所有陰性樣本中,得以正確檢測出陰性結果的機率,以TN/(FP+TN)計算,又稱為特異性(specificity)。
- False positive rate:代表所有陰性樣本中,檢測出假陽性的機率,以 FP/(TN+FP)計算,常以(1-SPC)的方式呈現。



ROC 曲線

- 接收者操作特徵(receiver operating characteristic, ROC curve)
- 1.以假陽性率(False Positive Rate, FPR)為X軸,代表在所有陰性相本中,被判斷為陽性(假陽性)的機率,又寫為(1-特異性)。
- 2.以真陽性率(True Positive Rate, TPR)為Y軸,代表在所有陽性樣本中
 - ,被判斷為陽性(真陽性)的機率,又稱為敏感性



AUC

曲線下面積(Area Under Curve, AUC)為此篩檢方式性能優劣之指標,AUC越接近1,代表此篩檢方式效能越佳。指標可參考以下條件。

AUC數值	解釋	
1	完美分類器,無論cut-off point如何設定都可	
R=R=R=R=R	正確預測。通常不存在	
0.5 <auc<1< td=""><td>優於隨機,妥善設定可有預測價值</td></auc<1<>	優於隨機,妥善設定可有預測價值	
0.5	同隨機,預測訊息沒有價值	

新聞分類 (使用NAÏVE BAYES)

新聞分類問題

- 1. 定義類別(垃圾郵件、非垃圾郵件)
- 2. 使用訓練資料的特徵(Feature)與類別建立模型
- 3. 根據輸入資料的特徵給予對應類別的機率值
- 4. 給予輸入資料類別

使用Naïve Bayes 分類器

■ Bayes 分類器源自Bayes 理論



Drew Barrymore



Drew Carey

What is the probability of being called "drew" given that you are a male?

What is the probability of being a male? $p(\text{male} \mid drew) = p(drew \mid \text{male}) p(\text{male})$ $p(drew) \leftarrow \qquad \qquad \text{What is the probability of being named "drew"?}$

(notually irralaziont cinca it is

Naïve Bayes 分類器

■ 假設每個特徵(Feature)都為獨立

$$p(d|c_j) = p(d_1|c_j) * p(d_2|c_j) ** p(d_n|c_j)$$

根據Feature d 所產生類別c 的機率

Naïve Bayes 分類器 (續)

■ 假設用Naïve Bayes 預測性別

$$p(\text{officer drew}|c_j) = p(\text{over}_170_{\text{cm}} = \text{yes}|c_j) * p(\text{eye} = blue|c_j) *$$



Officer Drew is blue-eyed, over 170_{cm} tall, and has long hair

```
p(\text{officer drew}| \text{ Female}) = 2/5 * 3/5 * ....

p(\text{officer drew}| \text{ Male}) = 2/3 * 2/3 * ....
```

取得新聞資料

```
import sqlite3
db = sqlite3.connect('news2.sqlite')
cur = db.cursor()
cur.execute('select title, summary, category from news_entry')
allNews = cur.fetchall()
corpus = []
tags = []
for rec in allNews:
  if (rec[2] == '娛樂'.decode('utf-8')) or (rec[2] == '社會'.decode('utf-8')):
                   corpus.append(' '.join(jieba.cut(rec[1])))
                   tags.append(rec[2])
cur.close()
db.close()
```

建立詞袋

```
import jieba
from sklearn.feature_extraction.text import
CountVectorizer
vectorizer = CountVectorizer()
X = vectorizer.fit_transform(corpus)
word = vectorizer.get_feature_names()
```

將資料分為訓練與測試資料集

```
from sklearn.cross_validation import
train_test_split
train_data, test_data, train_tag, test_tag =
train_test_split(X, tags, test_size=0.50,
random_state=42)
```

進行文章分類 (Multinomially Distributed)

from sklearn.naive_bayes import MultinomialNB

```
clf = MultinomialNB(alpha=0.01)
clf.fit(train_data,train_tag)
```

- ■用在文章分類中
 - □可根據詞袋
 - ☐TF-IDF
- Alpha 是避免沒有若不存在的特徵(Feature) 導 致計算停止

評量預測結果

pred = clf.predict(test_data)

from sklearn.metrics import confusion_matrix
confusion_matrix(test_tag, pred)

from sklearn.metrics import accuracy_score
print accuracy_score(test_tag, pred)

THANK YOU