

SVM 支持向量机

SVM 支持向量机

1. 线性svm

1.1 目标函数

1.2 拉格朗日函数

1.3 对偶问题和KKT条件

1.4 求解过程

2. 非线性可分样本和核函数

3 软间隔SVM

4 SMO算法

5 SVM面试常考题

5.1 为什么要转化成对偶问题求解SVM

5.2 核函数的选择问题

5.3 sklearn中SVM的参数使用

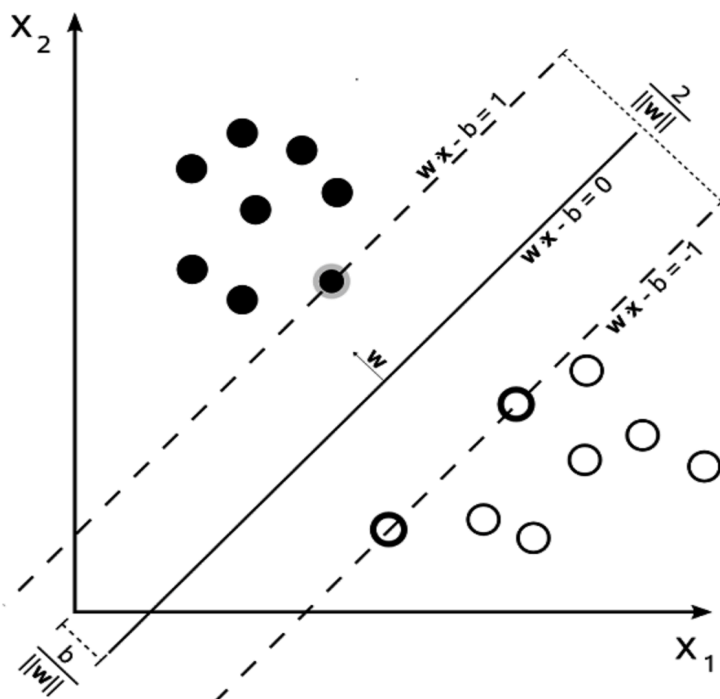
5.4 样本类别不均衡情况是否影响SVM分类效果

5.5 SVM多分类问题

1. 线性svm

1.1 目标函数

二维情况下的分类问题：



考虑多维情况的二分类问题，假设存在一个超平面能够将正负样本划分开，则所有的样本点满足以下条件：

$$\begin{aligned}w^T x_i + b &\geq 1 & y_i &= +1 \\w^T x_i + b &\leq -1 & y_i &= -1\end{aligned}$$

计算两个离超平面最近的正负样本的间隔距离，该样本点称为**支持向量**：

在n维空间中，分割超平面方程：

$$f(x) = w_1 x_1 + w_2 x_2 + w_3 x_3 \dots w_n x_n + b$$

假设距离分割超平面最近距离的样本点是 x_k ，计算距离：

$$d = 2 * \frac{|w^{(1)} x_k^{(1)} + w^{(2)} x_k^{(2)} + w^{(3)} x_k^{(3)} \dots + w^{(n)} x_k^{(n)} + b|}{||\vec{w}||^2} = \frac{2}{||\vec{w}||^2}$$

SVM的目的是在能够满足上述不等式的情况下，使得间隔距离最大，使得分类效果最好：

$$\begin{aligned}\max_{(w,b)} \quad & \frac{2}{||\vec{w}||^2} \\s.t. \quad & y_i(w^T x_i + b) \geq 1, i = 1, 2, 3..n\end{aligned}$$

转换成等价问题，得出目标函数：

$$\begin{aligned}\min_{(w,b)} \quad & \frac{1}{2} ||\vec{w}||^2 \\s.t. \quad & y_i(w^T x_i + b) - 1 \geq 0\end{aligned}$$

该问题带有不等式约束，可由拉格朗日乘子法求解。

1.2 拉格朗日函数

运用拉格朗日函数将不等式约束引入到目标函数中，方便求解：

$$L(w, b, \alpha) = \frac{1}{2} ||\vec{w}||^2 + \sum_i^N \alpha_i (1 - y_i(w^T x_i + b)), \alpha_i \geq 0$$

$L(w, b, \alpha)$ 对 α, β 求极大值，就等价于原目标函数

$$\begin{aligned}\max_{\alpha} L(w, b, \alpha) &= \begin{cases} \frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2, & (1 - y_i(w^T x_i + b)) < 0 \\ +\infty, & (1 - y_i(w^T x_i + b)) \geq 0 \end{cases} \\ &= \begin{cases} \frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2, & (y_i(w^T x_i + b) - 1) \geq 0 \\ +\infty, & (y_i(w^T x_i + b) - 1) < 0 \end{cases}\end{aligned}$$

-
1. 如果 $(1 - y_i(w^T x_i + b)) < 0$ ，那么 $\alpha_i(1 - y_i(w^T x_i + b))$ 一定小于等于0，为了使得 $L(w, b, \alpha)$ 取得极大值， α_i 一定等于0，这种情况下 $\max L(w, b, \alpha) = \frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2$ ，且满足不等式约束。
 2. 如果 $(1 - y_i(w^T x_i + b)) \geq 0$ ，那么 α_i 可以取任意无限大的值使得 $L(w, b, \alpha)$ 趋于无限大
-

再对上式求极小，可得：

$$\begin{aligned}\min_{w,b} \max_{\alpha} L(w, b, \alpha) &= \min_{w,b} \begin{cases} \frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2, & (y_i(w^T x_i + b) - 1) \geq 0 \\ +\infty, & (y_i(w^T x_i + b) - 1) < 0 \end{cases} \\ &= \min_{w,b} \frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2, \quad (y_i(w^T x_i + b) - 1) \geq 0 \quad (\text{原目标问题})\end{aligned}$$

这样，就将带有不等式约束条件的优化问题，转换成了对函数 $L(x, w, \alpha)$ 先求极大再求极小的问题，即目标问题转换成：

$$\text{目标问题等价于：} \min_{w,b} \max_{\alpha} L(w, b, \alpha) = \min_{w,b} \max_{\alpha} \left(\frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2 + \sum_i^N \alpha_i (1 - y_i(w^T x_i + b)) \right), \quad \alpha_i \geq 0$$

1.3 对偶问题和KKT条件

什么是对偶问题，通俗描述，就是将复杂问题转换成简单问题求解的方法

要想求解极值问题：

$$\min_{w,b} \max_{\alpha} L(w, b, \alpha) = \min_{w,b} \max_{\alpha} \left(\frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2 + \sum_i^N \alpha_i (1 - y_i(w^T x_i + b)) \right), \quad \alpha_i \geq 0 \quad \text{--- (1)}$$

我们可以将问题转换成这样的形式求解，能够简化问题的求解过程(后续会说明SVM为什么使用对偶)：

$$\max_{\alpha} \min_{w,b} L(w, b, \alpha) = \max_{\alpha} \min_{w,b} \left(\frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2 + \sum_i^N \alpha_i (1 - y_i(w^T x_i + b)) \right), \quad \alpha_i \geq 0 \quad \text{--- (2)}$$

假设(1)式的解为 w^*, b^*, α^* ，式(2)的解为 $w^{*d}, b^{*d}, \alpha^{*d}$ ，需证明

$$L(w^*, b^*, \alpha^*) = L(w^{*d}, b^{*d}, \alpha^{*d})$$

拉格朗日对偶性定理：

带不等式约束和等式约束的优化问题

$$\begin{aligned} \min_x & f(x) \\ \text{s.t. } & c_i(x) \leq 0, h_j(x) = 0 \end{aligned}$$

其拉格朗日函数：

$$L(x, \alpha, \beta) = f(x) + \sum_i^m \alpha_i c_i(x) + \sum_j^n \beta_j h_j(x)$$

假设，原问题 $\max_{\alpha, \beta} \min_x L(x, \alpha, \beta)$ 最优解为 x^*, α^*, β^* ，对应的最优值为 p^*

对偶问题 $\min_x \max_{\alpha, \beta} L(x, \alpha, \beta)$ 最优解为 $x^{*d}, \alpha^{*d}, \beta^{*d}$ ，对应的最优值为 d^*

定理1：

$$d^* = L(x^*, \alpha^*, \beta^*) \leq L(x^{*d}, \alpha^{*d}, \beta^{*d}) = p^*$$

定理2：

如果 1. $f(x), c_i(x)$ 为凸函数 2. $h_j(x)$ 为仿射函数 3. $c_i(x)$ 严格可行

那么：

$$p^* = d^* \text{ 的充要条件 } \iff KKT \text{ 条件 : } \begin{cases} \frac{d}{dx} L(x^*, \alpha^*, \beta^*) = 0 \\ \alpha_i^* c_i^* = 0 \text{ (松弛互补条件)} \\ c_i^*(x) \leq 0 \\ \alpha_i^* \geq 0 \\ h_j^*(x) = 0 \end{cases}$$

在原问题中， $\frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2, (y_i(w^T x_i + b) - 1)$ 均为凸函数，根据上述定理2可知，只要满足KKT条件，就可以用求解对偶问题来代替求解原问题。

综上，原问题等价于：

$$\begin{aligned} \max_{\alpha} \min_{w, b} L(w, b, \alpha) &= \max_{\alpha} \min_{w, b} \left(\frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2 + \sum_i^N \alpha_i (1 - y_i(w^T x_i + b)) \right) \\ \text{解必须满足 : } &\begin{cases} \alpha_i (1 - y_i(w^T x_i + b)) = 0 \\ (y_i(w^T x_i + b) - 1) \geq 0 \\ \alpha_i \geq 0 \end{cases} \end{aligned}$$

1.4 求解过程

目标函数：

$$L(w, b, \alpha) = \frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2 + \sum_i^N \alpha_i (1 - y_i (w^T x_i + b))$$

先求解：

$$\min_{w, b} L(w, b, \alpha)$$

分别对 w, b 求导,并令其为0:

$$\begin{aligned} w - \sum_i^N \alpha_i y_i x_i &= 0 \\ \sum_i^N \alpha_i y_i &= 0 \end{aligned}$$

将结果带入 $L(w, b, \alpha)$ ：

$$\begin{aligned} L(w, b, \alpha) &= \frac{1}{2} \left(\sum_i^N \alpha_i y_i x_i \right)^T \cdot \left(\sum_i^N \alpha_i y_i x_i \right) - \sum_i^N \alpha_i y_i \left(\left(\sum_j^N \alpha_j y_j x_j \right)^T \cdot x_i + b \right) + \sum_i^N \alpha_i \\ &= -\frac{1}{2} \sum_i^N \sum_j^N \alpha_i \alpha_j y_i y_j x_i^T x_j + \sum_i^N \alpha_i \\ s. t. \quad &\sum_i^N \alpha_i y_i = 0, \alpha_i \geq 0 \end{aligned}$$

现在参数只剩下 α , α 是一个N维的向量, 要求：

$$\begin{aligned} &\max_{\alpha} L(\alpha) \\ s. t. \quad &\sum_i^N \alpha_i y_i = 0, \alpha_i \geq 0 \end{aligned}$$

最后的参数用SMO求解, 文章最后会介绍。

用SMO求解不但要用到这个最终表达式, 还是用到对偶问题解成立的KKT条件：

$$\begin{cases} \alpha_i (1 - y_i (w^T x_i + b)) = 0 \\ (y_i (w^T x_i + b) - 1) \geq 0 \\ \alpha_i \geq 0 \end{cases}$$

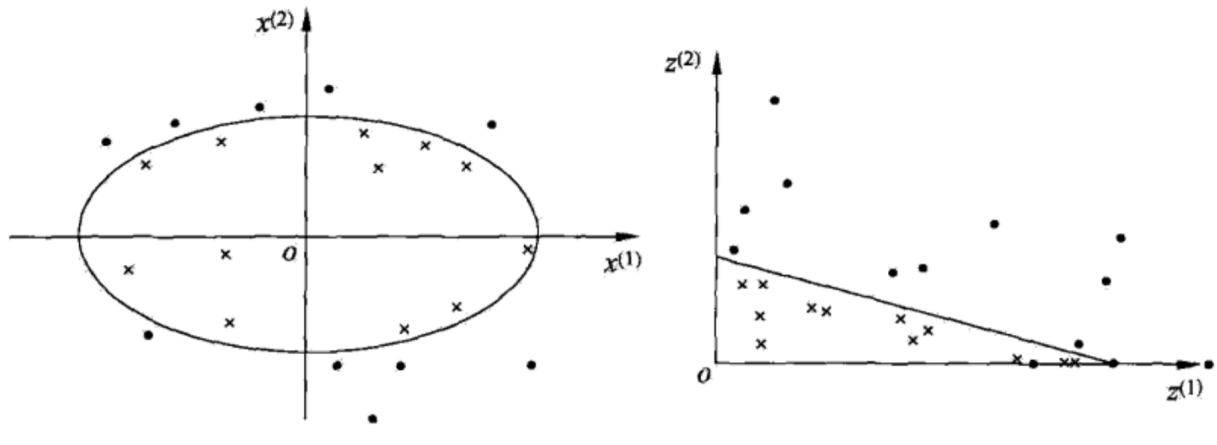
2. 非线性可分样本和核函数

接上, 最后的结果：

$$\begin{aligned} L(w, b, \alpha) &= -\frac{1}{2} \sum_i^N \sum_j^N \alpha_i \alpha_j y_i y_j x_i^T x_j + \sum_i^N \alpha_i \\ s. t. \quad &\sum_i^N \alpha_i y_i = 0, \alpha_i \geq 0 \end{aligned}$$

该结果来源于最初的假设，就是样本线性可分，我们用一个简单地线性超平面来分割样本集：

$$f(x) = w_1 x_1 + w_2 x_2 + w_3 x_3 \dots w_n x_n + b$$



假设二维的情况，用一条直线去分割二维空间,如右图：

$$f(x) = w_1 x_1 + w_2 x_2 + b$$

如果已知的样本点是非线性可分，如左图，那么最好的分割曲线应该是椭圆状曲线：

$$f(x) = w_1 x_1^2 + w_2 x_2^2 + b$$

设 $\phi(x)$ 为映射函数

$$\text{线性可分下} : \phi_1(x) = x$$

$$\text{椭圆情况下的映射} : \phi_2(x) = x^2$$

定义函数：

$$K_1(x_1, x_2) = \phi_1(x_1) \cdot \phi_1(x_2) = x_1 \cdot x_2$$

$$K_2(x_1, x_2) = \phi_2(x_1) \cdot \phi_2(x_2) = x_1^2 \cdot x_2^2$$

根据上述推导，线性可分情况的解：

$$L(w, b, \alpha) = -\frac{1}{2} \sum_i^N \sum_j^N \alpha_i \alpha_j y_i y_j K_1(x_i, x_j) + \sum_i^N \alpha_i$$

$$s. t. \sum_i^N \alpha_i y_i = 0, \alpha_i \geq 0$$

同理可得出线性不可分，椭圆曲线分割线情况下的解：

$$L(w, b, \alpha) = -\frac{1}{2} \sum_i^N \sum_j^N \alpha_i \alpha_j y_i y_j K_2(x_i, x_j) + \sum_i^N \alpha_i$$

$$s. t. \sum_i^N \alpha_i y_i = 0, \alpha_i \geq 0$$

形如这种，能够将样本点映射到特定空间的函数 $K(x_i, x_j)$ 称为核函数

常用核函数

$$\text{线性核: } K(x_i, x_j) = x_i^T x_j$$

$$\text{多项式核: } K(x_i, x_j) = (\xi + \gamma x_i^T x_j)^d$$

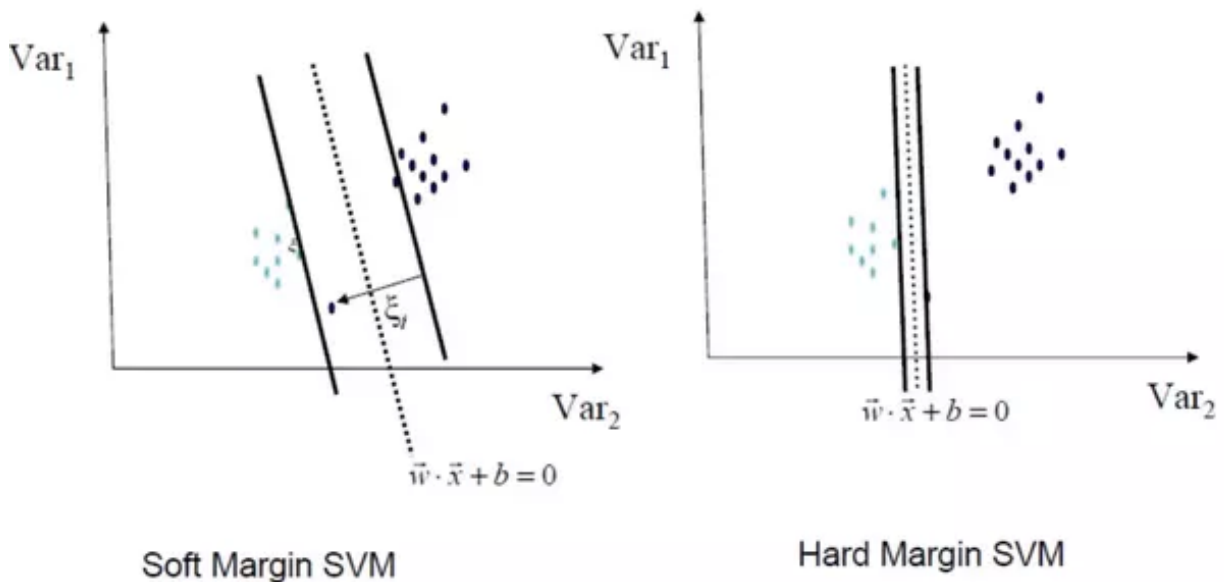
$$\text{高斯核: } K(x_i, x_j) = \exp(-\gamma \|x_i - x_j\|^2)$$

$$\text{拉普拉斯核: } K(x_i, x_j) = \exp\left(-\frac{\|x_i - x_j\|}{\sigma}\right)$$

$$\text{sigmoid核: } K(x_i, x_j) = \tanh(\gamma x_i^T x_j + \xi)$$

3 软间隔SVM

有些数据集虽然大体上是线性可分的，但会有一些点，可能是噪点或是异常点，使得求出严格的分割平面较为困难，软间隔就是为了解决这样的问题，通过放松条件，允许每个点都可以有一定程度的越界，引入参数 ξ_i 来表示每个样本点的越界程度，该参数称为松弛变量，最后通过最小化该参数使所有点的越界程度最小，即达到最好的分类效果，也容忍了一定程度的噪点问题。



分类条件:

$$w^T x_i + b \geq 1 - \xi_i \quad y_i = +1$$

$$w^T x_i + b \geq \xi_i - 1 \quad y_i = -1$$

优化目标：

$$\min_{w,b,\xi} \frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^N \xi_i$$

$$\text{s.t. } y_i (w \cdot x_i + b) \geq 1 - \xi_i, \quad \xi_i \geq 0$$

C称为惩罚因子，C值得大小表征对越界的容忍程度，即惩罚力度的大小。对松弛参数的理解，可以类比在其他学习算法中的正则项，通过引入正则项来防止过拟合。如上左图，如果用硬间隔SVM，中间那个异常点将会起到支持向量的作用，那么正负样本的间隔将会非常小，这可以类比成一种过拟合。

推导过程与不带松弛参数的线性SVM类似：

写出拉格朗日方程：

$$L(w, b, \xi, \alpha, \mu) \equiv \frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^N \xi_i - \sum_{i=1}^N \alpha_i (y_i (w \cdot x_i + b) - 1 + \xi_i) - \sum_{i=1}^N \mu_i \xi_i$$

$$\text{s.t. } \alpha_i \geq 0, \mu_i \geq 0$$

原问题：

$$\min_{w,b,\xi} \max_{\alpha,\mu} L(w, b, \xi, \alpha, \mu)$$

转换成对偶问题：

$$\max_{\alpha,\mu} \min_{w,b,\xi} L(w, b, \xi, \alpha, \mu) = \min_{w,b,\xi} \max_{\alpha,\mu} L(w, b, \xi, \alpha, \mu)$$

$$\text{s.t. } KKT$$

转换成对偶问题后就可以先对 w, b, ξ 求导求极小值：

$$\nabla_w L(w, b, \xi, \alpha, \mu) = w - \sum_{i=1}^N \alpha_i y_i x_i = 0$$

$$\nabla_b L(w, b, \xi, \alpha, \mu) = - \sum_{i=1}^N \alpha_i y_i = 0$$

$$\nabla_{\xi_i} L(w, b, \xi, \alpha, \mu) = C - \alpha_i - \mu_i = 0$$

回到原函数，可以发现，正好消去了 ξ, w, b

最后，又得出以下熟悉的形式

$$\min_{\alpha} L(w, b, \xi, \alpha, \mu) = -\frac{1}{2} \sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^N \alpha_i \alpha_j y_i y_j (x_i^T x_j) + \sum_{i=1}^N \alpha_i$$

$$\text{s.t. } \sum_{i=1}^N \alpha_i y_i = 0$$

$$0 \leq \alpha_i \leq C$$

与之前的推导结果唯一不同的是 α_i 有了上界的限制，该限制来自于上述对 ξ 求导的结果
 $C - \alpha_i - \mu_i = 0$

最后，相应的KKT条件：

$$\begin{cases} (y_i (w \cdot x_i + b) - 1 + \xi_i) \geq 0 \\ \alpha_i (y_i (w \cdot x_i + b) - 1 + \xi_i) = 0 \\ \alpha_i \geq 0 \\ \mu_i \geq 0 \\ \xi_i \geq 0 \end{cases}$$

4 SMO算法

SMO算法SVM的最后一步，是用于计算SVM的最后参数 α 的一种优化算法。

以最一般化的SVM来做SMO的计算，带软间隔，带核函数的情况：

$$\begin{aligned} \text{分割面: } f(x_i) = w\phi(x_i) + b &= \sum_j^N \alpha_j y_j K(x_i, x_j) + b \quad \text{--- (1)} \\ (w &= \sum_j^N \alpha_j y_j \phi(x_j)) \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{优化目标: } \min_{\alpha} L(w, b, \xi, \alpha, \mu) &= -\frac{1}{2} \sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^N \alpha_i \alpha_j y_i y_j K(x_i, x_j) + \sum_{i=1}^N \alpha_i \\ \text{s.t. } \sum_{i=1}^N \alpha_i y_i &= 0 \\ 0 \leq \alpha_i &\leq C \end{aligned}$$

$$KKT \text{ 条件: } \begin{cases} (y_i (w \cdot x_i + b) - 1 + \xi_i) \geq 0 \\ \alpha_i (y_i (w \cdot x_i + b) - 1 + \xi_i) = 0 \\ \alpha_i \geq 0 \\ \mu_i \geq 0 \\ \xi_i \geq 0 \end{cases}$$

计算步骤：

每次迭代只选择N个 α_i 中的两个 α_i 做优化，最终达到所有 α 收敛的效果

指定一个分类精度 ε ，来控制收敛的精度

1. 随机初始化所有 α ， b

2. 根据 $f(x_i)$ 计算误差

$$E_i = f(x_i) - y_i \quad \text{--- (2)}$$

3. 循环选择一个最不满足KKT条件的 α_v ，如下选择规则：

$$\begin{aligned} \alpha_v < C \quad \text{and} \quad E_v < -\varepsilon \\ \text{or} \\ 0 < \alpha_v \quad \text{and} \quad E_v > \varepsilon \end{aligned}$$

--- (3)

如果找不到，退出循环，优化结束

有些算法用随机选择的方法选择第一 α_v 这样的做法收敛较慢

4. 根据选择出来的 α_v 循环寻找 α_w 使得 $|E_v - E_w|$ 最大

5. 计算L,H

$$if \ y_v == y_w$$

$$L = \max(0, \alpha_w + \alpha_v - C), \quad H = \min(C, \alpha_w + \alpha_v)$$

else

$$L = \max(0, \alpha_w - \alpha_v), \quad H = \min(C, C + \alpha_w - \alpha_v)$$

6. 更新 α_w 的值

$$\alpha'_w = \alpha_w^{\text{old}} + \frac{y_w (E_v - E_w)}{\eta}$$

$$\eta = K(x_v, x_v) + K(x_w, x_w) - 2K(x_v, x_w) \quad (\eta \geq 0) \quad --- (4)$$

$$\alpha_w^{\text{new}} = \begin{cases} H, & \alpha'_w > H \\ \alpha'_w & L \leq \alpha'_w \leq H \\ L, & \alpha'_w < L \end{cases} \quad --- (5)$$

7. 更新 α_v 的值

$$\alpha_v^{\text{new}} = \alpha_v^{\text{old}} + y_1 y_2 (\alpha_w^{\text{old}} - \alpha_w^{\text{new}}) \quad --- (6)$$

8. 计算b

$$b_v^{\text{new}} = -E_v - y_v K(x_v, x_v) (\alpha_v^{\text{new}} - \alpha_v^{\text{old}}) - y_w K(x_w, x_v) (\alpha_w^{\text{new}} - \alpha_w^{\text{old}}) + b^{\text{old}}$$

$$b_w^{\text{new}} = -E_w - y_v K(x_v, x_w) (\alpha_v^{\text{new}} - \alpha_v^{\text{old}}) - y_w K(x_w, x_w) (\alpha_w^{\text{new}} - \alpha_w^{\text{old}}) + b^{\text{old}}$$

if $0 < \alpha_v^{new} < C$:

$$b^{new} = b_v^{new}$$

else if $0 < \alpha_w^{new} < C$:

$$b^{new} = b_w^{new}$$

else:

$$b^{new} = \frac{1}{2}(b_v^{new} + b_w^{new})$$

9. 跳回2

```
def SVM(X, y, C, e, maxEpoch):  
  
    #N是样本数, D是样本维度  
    N,D = shape(X)  
  
    #初始化alpha,b  
    alphas = np.zeros(N,1)  
    b = 0;  
  
    for i in range(maxEpoch):  
  
        for v in range(N): #在数据集上遍历每一个alpha  
  
            #(1)式  
            #如果需要加核函数 :  fx_v = (alphas*y).T*K(x,x[v]) + b  
            fx_v = (alphas*y).T*(X.dot(X[v].T)) + b  
  
            #(2)式  
            E_v = fx_v-y[v]  
  
            #根据(3)式规则选择alpha_v  
            if ( ( y[v]*E_v < -e ) and ( alphas[v]<C ) ) or \  
                ( ( y[v]*E_v > e ) and ( alphas[v]>0 ) ):  
  
                #根据第四点选择alpha_w  
                w = -1  
                E_w = -1  
                tempMax = -1  
                for j in range(N):  
                    if j==v:  
                        continue  
                    fx_j = (alphas*y).T*(X.dot(X[j].T)) + b  
                    E_j = fx_j-y[j]  
                    if abs(E_v-E_j) > tempMax:
```

```

        E_w = E_j
        w = j

alphaIold=alphas[i].copy() #复制下来，便于比较
alphaJold=alphas[j].copy()

#根据第五点计算L和H
if (y[v]!=y[w]):
    L=max(0, alphas[w]-alphas[v])
    H=min(C, C+alphas[w]-alphas[v])
else:
    L=max(0, alphas[w]+alphas[v]-C)
    H=min(C, alphas[w]+alphas[v])
if L==H:
    print('L==H')
    continue

#根据式4计算eta
eta= X[i]*X[i].T + X[j]*X[j].T - 2.0*X[v]*X[w].T
if eta<0:
    print('eta<0')
    continue

#根据式5计算更新alpha_w
alpha_w_old = alphas[w]
alphas[w]+=y[w]*(E_v-E_w)/eta #调整alphas[j]
if alphas[w]>H:
    alphas[w]=H
if alphas[w]<L:
    alphas[w]=L

#如果变化很小，后面就不做了，直接下一轮更新
if(abs(alphas[w]-alpha_w_old)<0.00001):
    print('w not moving enough')
    continue

#根据式6计算更新alpha_v
alpha_v_old=alphas[v]
alphas[v]+=y[w]*y[v]*(alpha_w_old-alphas[w]) #调整alphas[i]

#根据第八点计算b
b_v = b-E_v-\
y[v]*(alphas[v]-alpha_v_old)*X[v]*X[v].T-\
y[w]*(alphas[w]-alpha_w_old)*X[w]*X[v].T

b_w = b-E_w-\
y[v]*(alphas[v]-alpha_v_old)*X[v]*X[w].T-\

```

```

y[w]*(alphas[w]-alpha_w_old)*X[w]*X[w].T

if(0<alphas[i]) and (C>alphas[i]):
    b=b_v
elif(0<alphas[j]) and (C>alphas[j]):
    b=b_w
else:
    b=(b_v+b_w)/2.0

return b, alphas

```

5 SVM面试常考题

5.1 为什么要转化成对偶问题求解SVM

原问题：

$$\min_{w,b} \max_{\alpha} L(w, b, \alpha) = \min_{w,b} \max_{\alpha} \left(\frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2 + \sum_i^N \alpha_i (1 - y_i (w^T x_i + b)) \right), \alpha_i \geq 0 \quad \text{--- (1)}$$

对偶问题：

$$\max_{\alpha} \min_{w,b} L(w, b, \alpha) = \max_{\alpha} \min_{w,b} \left(\frac{1}{2} \|\vec{w}\|^2 + \sum_i^N \alpha_i (1 - y_i (w^T x_i + b)) \right), \alpha_i \geq 0 \quad \text{--- (2)}$$

- 求解问题的复杂度不同，原问题最外层的是 $\min_{w,b}$ ，最后求解问题的复杂度和 w 的维度相关，即，和样本的维度相关。而对偶问题的外层是 \max_{α} ，最后的求解问题与 α 的维度相关，即，和样本数量相关。传统机器学习最初是针对高纬度低样本数的数据进行设计的(人工智能课老师)，所以svm对于高维空间中较稀疏的样本表现较好。
- 能够运用核函数(主要原因)， $L(w, b, \alpha)$ 只有先对 w, b 求导才能导出最后带有 $(x_i \cdot x_j)$ 的形式，才有机会运用核函数来应对非线性情况
- 引入了KKT条件，简化了约束条件

5.2 核函数的选择问题

吴恩达的选择：

- 特征数量很大，跟样本差不多时，用线性核
- 特征数量比较小，样本数量很大，需手动添加特征，后用线性核
- 特征数量比较小，样本数量一般，用高斯核

从调参复杂度选择

线性核：无

多项式核：幂次 d , 系数 γ , 常数项 ξ

高斯核：系数 γ

sigmoid核：系数 γ ,常数项 ξ

5.3 sklearn中SVM的参数使用

```
class sklearn.svm.SVC(  
    C=1.0,  
    kernel='rbf',  
    degree=3,  
    gamma='auto',  
    coef0=0.0,  
    shrinking=True,  
    probability=False,  
    tol=0.001,  
    cache_size=200,  
    class_weight=None,  
    verbose=False,  
    max_iter=-1,  
    decision_function_shape='ovr',  
    random_state=None)
```

主要需要调整的参数：

C： 对应上文的C，软间隔中的惩罚因子

kernel：核函数 'linear', 'poly', 'rbf', 'sigmoid', 'precomputed'，默认rbf

degree：kernel为多项式核的时候有效，调整的是多项式核的幂次

gamma： 当kernel为'rbf', 'poly'或'sigmoid'时生效，对应的核函数中的gamma值

coef0： 当kernel为'poly', 'sigmoid'时有效

tol： 训练精度，对应上面SMO的精度

max_iter：对应上述的maxEpoch

5.4 样本类别不均衡情况是否影响SVM分类效果

会有影响，原因：

$$\min_{w,b,\xi} \frac{1}{2} \|w\|^2 + C \sum_{i=1}^N \xi_i$$

假设负样本的数量远大于正样本的数量，那么负样本越界的点一定大于正样本越界的点，算法最小化 $C \sum_i \xi_i$ 会使得超平面往正样本移动，来减少负样本越界的点，从而减小 $C \sum_i \xi_i$ 。

如何解决：

1. 对正样本和负样本设置不同的C，来保证平衡
2. 欠采样

5.5 SVM多分类问题

一对一法：

任意两类样本之间设计一个SVM，最终有 $k(k-1)/2$ 个分类器，投票决定

一对多法：

把某个类别的样本归为一类，其余类别归为另一类，做一个SVM，这样， k 个类别就有 k 个SVM，样本经过 k 个SVM分别计算，以函数值最大的那个类别为最终类别