

Formelsammlung

July 7, 2018

Contents

1	Bayes'scher Ansatz	3
1.1	Entscheidungsregionen	3
1.1.1	Ungleiche Klassifizierungswahrscheinlichkeit	3
1.1.2	Fehlklassifizierung	3
1.1.3	Umformung	3
1.1.4	pq-Formel	4
1.2	Zurückweisung	4
2	Lineare Klassifikatoren	5
2.1	Fisher Diskriminante	5
2.2	Lineare Kleinste Quadrate	6
3	Perceptron	6
4	Lösungen für Probeklausur	6
4.1	ProbeKlausur Muster SS17	6

1 Bayes'scher Ansatz

1.1 Entscheidungsregionen

Bei gleicher Klassifizierungswahrscheinlichkeit gilt

$$p(x|C_1) = p(x|C_2)$$

$$p(x|C_i) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma_i^2}} \cdot e^{-\frac{\frac{1}{2}(x-\mu_i)^2}{\sigma_i^2}}$$

1.1.1 Ungleiche Klassifizierungswahrscheinlichkeit

Wenn eine Klasse wahrscheinlicher ist so gilt

$$p(C_1) \cdot p(x|C_1) = p(x|C_2) \cdot p(C_2)$$

$$\frac{p(C_1)}{p(C_2)} \cdot \frac{\sqrt{2\pi\sigma_2^2}}{\sqrt{2\pi\sigma_1^2}} = e^{-\frac{\frac{1}{2}(x-\mu_2)^2}{\sigma_2^2} - \frac{\frac{1}{2}(x-\mu_1)^2}{\sigma_1^2}}$$

$\frac{p(C_1)}{p(C_2)}$ definieren wir als \mathcal{P} . Als Reziproke von \mathcal{P} bezeichnen wir \mathcal{P}' . Bei gleichen Wahrscheinlichkeiten $p(C_{1/2}) = 0,5$ ist $\mathcal{P} = 1$ und kann ignoriert werden.

1.1.2 Fehlklassifizierung

Wenn eine Verlustmatrix V gegeben ist so wird die Gewichtung der Fehlklassifikation pro Klasse berücksichtigt über

$$V_{1,2} \cdot p(x|C_1) = p(x|C_2) \cdot V_{2,1}$$

$$\frac{V_{1,2}}{V_{2,1}} \cdot \frac{\sqrt{2\pi\sigma_2^2}}{\sqrt{2\pi\sigma_1^2}} = e^{-\frac{\frac{1}{2}(x-\mu_2)^2}{\sigma_2^2} - \frac{\frac{1}{2}(x-\mu_1)^2}{\sigma_1^2}}$$

$\frac{V_{1,2}}{V_{2,1}}$ definieren wir als \mathcal{V} . Bei gleicher Verlustgewichtung $V_{(1/2),(2/1)} = x$ ist $\mathcal{V} = 1$ und kann ignoriert werden.

1.1.3 Umformung

Mit diesen Parametern kann die Formel wie folgt umgeformt werden

$$\ln(\mathcal{P} \cdot \mathcal{V} \cdot \frac{\sqrt{\sigma_2^2}}{\sqrt{\sigma_1^2}}) = \frac{-\frac{1}{2}(x-\mu_2)^2}{\sigma_2^2} - \frac{-\frac{1}{2}(x-\mu_1)^2}{\sigma_1^2} \quad (1)$$

$$\sigma_2^2 \cdot \sigma_1^2 \cdot \ln(\mathcal{P} \cdot \mathcal{V} \cdot \frac{\sqrt{\sigma_2^2}}{\sqrt{\sigma_1^2}}) = -\frac{1}{2} \cdot \sigma_1^2 (x - \mu_2)^2 - \frac{1}{2} \cdot \sigma_2^2 (x - \mu_1)^2 \quad (2)$$

$$= \sigma_1^2 (x^2 - 2\mu_2 x + \mu_2^2) - \sigma_2^2 (x^2 - 2\mu_1 x + \mu_1^2) \quad (3)$$

$$= (\sigma_1^2 - \sigma_2^2) \cdot x^2 + (-\mu_2 \sigma_1^2 + \mu_1 \sigma_2^2) 2x + \sigma_1^2 \mu_2^2 - \sigma_2^2 \mu_1^2 \quad (4)$$

$$0 = (\sigma_1^2 - \sigma_2^2) \cdot x^2 + (-\mu_2 \sigma_1^2 + \mu_1 \sigma_2^2) 2x + \sigma_1^2 \mu_2^2 - \sigma_2^2 \mu_1^2 + 2 \cdot \sigma_2^2 \cdot \sigma_1^2 \cdot \ln(\mathcal{P} \cdot \mathcal{V} \cdot \frac{\sqrt{\sigma_2^2}}{\sqrt{\sigma_1^2}}) \quad (5)$$

1.1.4 pq-Formel

Benötigt einen Ausdruck der Form $x^2 + px + q = 0$. Um die pq-Formel $x_{1/2} = -\frac{p}{2} \pm \sqrt{(\frac{p}{2})^2 - q}$ anzuwenden muss der Term mit $/\div (\sigma_1^2 - \sigma_2^2)$ umgeformt werden

1.2 Zurückweisung

$$p(C_1|x) \geq \theta$$

$$p(C_1|x) = \frac{p(C_1) \cdot p(x|C_1)}{p(x)}$$

$$p(x) = p(C_1) \cdot p(x|C_1) + p(C_2) \cdot p(x|C_2)$$

$$\frac{p(C_1) \cdot p(x|C_1)}{p(C_1) \cdot p(x|C_1) + p(C_2) \cdot p(x|C_2)} \geq \theta$$

Dieser Ausdruck hat die Form $\frac{A}{A+B}$ was umgeformt werden kann in $\frac{1}{1+\frac{B}{A}}$

$$\frac{1}{1 + \frac{p(C_2) \cdot p(x|C_2)}{p(C_1) \cdot p(x|C_1)}} \geq \theta$$

$$1 \geq \theta \left(1 + \frac{p(C_2) \cdot p(x|C_2)}{p(C_1) \cdot p(x|C_1)} \right) \quad (6)$$

$$\frac{1}{\theta} \geq 1 + \mathcal{P}' \cdot \frac{p(x|C_2)}{p(x|C_1)} \quad (7)$$

$$\frac{1}{\theta} - 1 \geq \mathcal{P}' \cdot \frac{\frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma_2^2}} \cdot e^{-\frac{\frac{1}{2}(x-\mu_2)^2}{\sigma_2^2}}}{\frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma_1^2}} \cdot e^{-\frac{\frac{1}{2}(x-\mu_1)^2}{\sigma_1^2}}} \quad (8)$$

$$\frac{1}{\theta} - 1 \geq \mathcal{P}' \cdot \frac{\sqrt{2\pi\sigma_1^2}}{\sqrt{2\pi\sigma_2^2}} \cdot e^{-\frac{\frac{1}{2}(x-\mu_2)^2}{\sigma_2^2} - \frac{\frac{1}{2}(x-\mu_1)^2}{\sigma_1^2}} \quad (9)$$

Nun kann analog zu 1 der Term weiter umgeformt werden zu

$$0 = (\sigma_1^2 - \sigma_2^2) \cdot x^2 + (-\mu_2 \sigma_1^2 + \mu_1 \sigma_2^2) 2x + \sigma_1^2 \mu_2^2 - \sigma_2^2 \mu_1^2 + 2 \cdot \sigma_1^2 \cdot \sigma_2^2 \cdot \ln\left(\frac{1}{\theta} - 1\right) \cdot \mathcal{P}' \cdot \frac{\sqrt{\sigma_2^2}}{\sqrt{\sigma_1^2}}$$

Nun muss für $p(C_2|x)$ dies Analog geschehen

$$\begin{aligned} \frac{p(C_2) \cdot p(x|C_2)}{p(C_1) \cdot p(x|C_1) + p(C_2) \cdot p(x|C_2)} &\geq \theta \\ \frac{1}{1 + \frac{p(C_1) \cdot p(x|C_1)}{p(C_2) \cdot p(x|C_2)}} &\geq \theta \\ \frac{1}{\theta} &\geq 1 + \mathcal{P} \cdot \frac{p(x|C_1)}{p(x|C_2)} \\ \frac{1}{\theta} - 1 &\geq \mathcal{P} \cdot \frac{\sqrt{2\pi\sigma_2^2}}{\sqrt{2\pi\sigma_1^2}} \cdot e^{-\frac{\frac{1}{2}(x-\mu_1)^2}{\sigma_1^2} - \frac{\frac{1}{2}(x-\mu_2)^2}{\sigma_2^2}} \end{aligned}$$

$$0 = (\sigma_2^2 - \sigma_1^2) \cdot x^2 + (-\mu_1 \sigma_2^2 + \mu_2 \sigma_1^2) 2x + \sigma_2^2 \mu_1^2 - \sigma_1^2 \mu_2^2 + 2 \cdot \sigma_1^2 \cdot \sigma_2^2 \cdot \ln\left(\frac{1}{\theta} - 1\right) \cdot \mathcal{P} \cdot \frac{\sqrt{\sigma_1^2}}{\sqrt{\sigma_2^2}}$$

2 Lineare Klassifikatoren

2.1 Fisher Diskriminante

Berechnen des Klassenmittelpunktes μ der Klasse i

$$\mu_i = \frac{1}{|i|} \left(\sum_{k \in C_i} x_k \right)$$

Berechnen der Kovarianz zwischen den Klassen

$$S_B = (\mu_2 - \mu_1)(\mu_2 - \mu_1)^T$$

Berechnen der Gesamtkovarianz innerhalb der Klassen

$$S_W = \sum_{k \in C_1} (x_k - \mu_1)(x_k - \mu_1)^T + \sum_{k \in C_2} (x_k - \mu_2)(x_k - \mu_2)^T$$

$$w^* = S_W^{-1}(\mu_2 - \mu_1)$$

$$w_0^* = w^{*T} \frac{1}{N} (N_1 \mu_1 + N_2 \mu_2)$$

wobei N die Anzahl aller klassifizierten Vektoren und N_i die Anzahl der Vektoren die in der Klasse i ist

Klassifizieren eines Vektors V wird durch

$$cw^{*T} \cdot V - w_0$$

Wenn das signum der Ergebnisses gibt die Klassifizierung an

2.2 Lineare Kleinste Quadrate

3 Perceptron

Überführung des Inputs in höher Dimensionales Problem $x \in R^{D+1}$

$$\begin{aligned}x &= \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 & \dots \\ x_1 & x_2 & x_3 & x_4 & \dots \\ y_1 & y_2 & y_3 & y_4 & \dots \\ \vdots & & & & \end{pmatrix} \\g &= w^T x + w_0 \cdot 1 \\&= (w_1 \quad w_2) \cdot \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} + w_0 \cdot 1 \\&= (w_0 \quad w_1 \quad w_2) \cdot \begin{pmatrix} 1 \\ x_1 \\ x_2 \end{pmatrix}\end{aligned} \tag{10}$$

4 Lösungen für Probeklausur

4.1 ProbeKlausur Muster SS17

- 1)
 - a:
 - b: $x_1 = 1,07449, x_2 = 8,06836$
 - c: $x_1 = 0,590907, x_2 = 8,55195$
 - d: $x_1 = 1,00744, x_2 = 8,13541$
 - e:
 $p(C_1|x) : x_1 = 0,8805, x_2 = 8.26236$
 $p(C_2|x) : x_1 = 1,2799, x_2 = 7,8629$
- 2)
 - a:
 - b:
 $S_w = \begin{pmatrix} 5 & 3 \\ 3 & 2 \end{pmatrix}$
 $w^* = \begin{pmatrix} -4 \\ 9 \end{pmatrix}$
 - c:
 - d:
- 3)

- a:
- b:
- c:
- d: