

# Deep Learning Basics

---

## Deep Learning Basics

### 基本模型

- 经典回归模型[CS229]

- 损失函数(cost function)

- 深度神经网络

- 自动求导

### 主要网络

- 单层网络

- 多层感知器

- CNN

- DNN

- 简单总结

### 优化方法

#### 优化算法

- 学习率调整（含梯度估计修正）

- 批量大小

- 参数初始化

- 数据预处理[Book NNDL]

- 超参数优化[JRYB2011]

#### 网络正则化

- L1/L2正则

- 权重衰减

- 丢弃法

### 库和框架

- 深度学习库对比

- Keras

- PyTorch

- 深度学习框架对比

### 参考

## 基本模型

---

在介绍所有的库支持，参考[Book PDSH]熟悉Python、Numpy、Pandas、Matplotlib以及sklearn库。

### 经典回归模型[CS229]

假设输入是符合特征为 $x \in R^d$ 的样本，偏差项为 $b$ ， $W$ 是权重（矩阵）参数， $\hat{y}$ 是对 $y$ 的预估，经典回归模型可以表达如下：

$$\hat{y} = Wx + b$$

有时候bias  $b$ 可以作为 $W$ 的一列进行表示. 也被写作 $\theta$ ,  $W$ 和 $b$ 都是张量。

## 损失函数(cost function)

定义为：

$$Loss(W, b) = \|\hat{y} - y\|_p$$

$p$  一般取1、2或者 $\infty$ .

学习的目标：

$$W, b = \arg \min_{W, b} Loss(W, b)$$

## 深度神经网络

包含如下4个主要对象：

- 层，各层链接形成model或者网络
- 输入输出和对应的目标
- 损失函数
- 优化器

基本原理：

1) 正向传播

$$\begin{aligned} z &= W^{(1)}x \\ h &= \phi(z) \\ o &= W^{(2)}h \\ L &= Loss(o, y) \\ s &= \frac{\lambda}{2}(\|W^{(1)}\|_F^2 + \|W^{(2)}\|_F^2) \\ J &= L + s \end{aligned}$$

目标函数 $J(W, b, \lambda)$ 为带正则项的损失函数,其中  $W^{(1)} \in R^{h \times d}$  是隐藏层权重参数,  $z \in R^h$  是隐藏层变量,  $o \in R^q$  是输出层变量,  $W^{(2)} \in R^{q \times h}$  是输出层权重, 假设损失函数为Loss, 样本标签是 $y$ . 给定超参为 $\lambda$ , 计算正则项  $s$ ,

2) 反向传播

相对正向传播计算出代价函数, 反向传播目标是通过求梯度, 计算 $(W, b)$ 。首先计算目标函数 $J$ 有关损失项 $L$ 和正则项 $s$ . 需要借助链式法则。

推导过程如下：

$$\begin{aligned}
\frac{\partial J}{\partial L} &= 1, \frac{\partial J}{\partial s} = 1 \\
\frac{\partial J}{\partial o} &= \frac{\partial J}{\partial L} \cdot \frac{\partial L}{\partial o} = \frac{\partial L}{\partial o} \\
\frac{\partial s}{\partial W^{(1)}} &= \lambda W^{(1)}, \frac{\partial s}{\partial W^{(2)}} = \lambda W^{(2)} \\
\frac{\partial J}{\partial W^{(2)}} &= \frac{\partial J}{\partial o} \cdot \frac{\partial o}{\partial W^{(2)}} + \frac{\partial J}{\partial s} \cdot \frac{\partial s}{\partial W^{(2)}} = \frac{\partial J}{\partial o} h^T + \lambda W^{(2)} \\
\frac{\partial J}{\partial h} &= \frac{\partial J}{\partial o} \cdot \frac{\partial o}{\partial h} = W^{(2)T} \frac{\partial J}{\partial o} \\
\frac{\partial J}{\partial z} &= \frac{\partial J}{\partial h} \cdot \frac{\partial h}{\partial z} = \frac{\partial h}{\partial z} \cdot \phi'(z) \\
\frac{\partial J}{\partial W^{(1)}} &= \frac{\partial J}{\partial o} \cdot \frac{\partial o}{\partial W^{(1)}} + \frac{\partial J}{\partial s} \cdot \frac{\partial s}{\partial W^{(1)}} = \frac{\partial J}{\partial z} x^T + \lambda W^{(1)}
\end{aligned}$$

其中注意 $\cdot$ 表示向量的内积，可能需要对向量调整(专职或者互换输入位置等)。以上推导过程参考[Book DIDL].

基本过程如下：

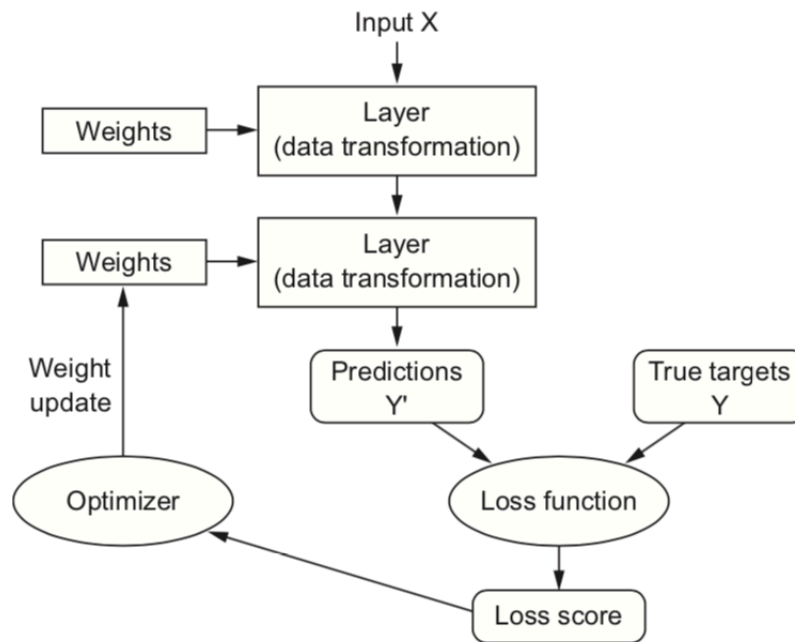


图1：深度学习计算过程，来自[Book DLP]

## 自动求导

文章[COCG]给出了基于计算图进行后向传播计算的原因，主要原因是相对前向传播来说，便于一次性算出所有的目标梯度。MXNet提供了对任意函数求梯度的方法, 例子

见 `./example/mxnet2.3.1_autograd.py`。

课程[AG]将微分求解分为有如下几种：

- 符号微分：是指基于计算图进行微分计算，常借助于求和、乘积以及链式法则等。类似前向计算，出现指数级计算复杂度；
- 数值微分：利用微分定义计算，误差较大。

- 后向传播(自动梯度): 利用计算图进行后向传播计算, 例如计算  $f = \frac{1}{1 + e^{-(w_0 + w_1 x_1 + w_2 x_2)}}$ , 以运算操作符为点, 数据流为边, 建立数据流图如下图的黑色部分, 红色部分是后向梯度计算。

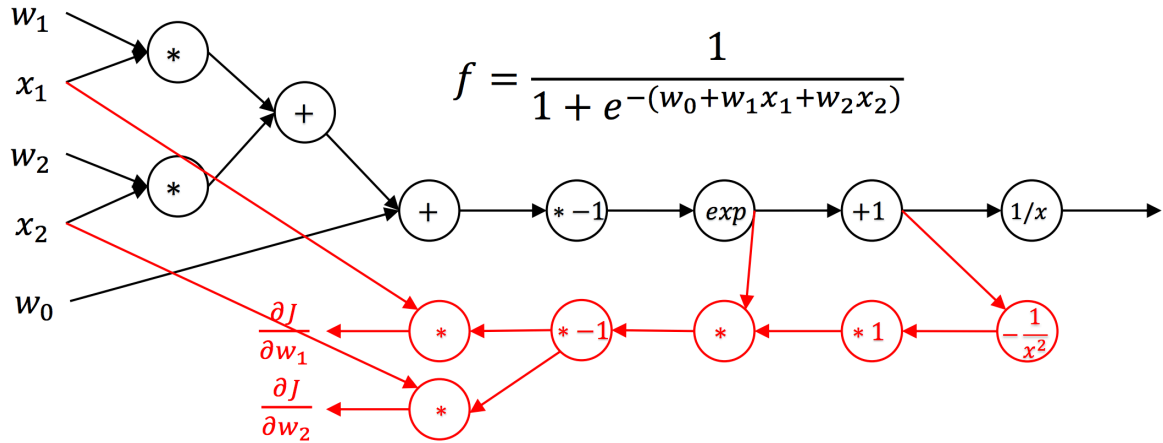
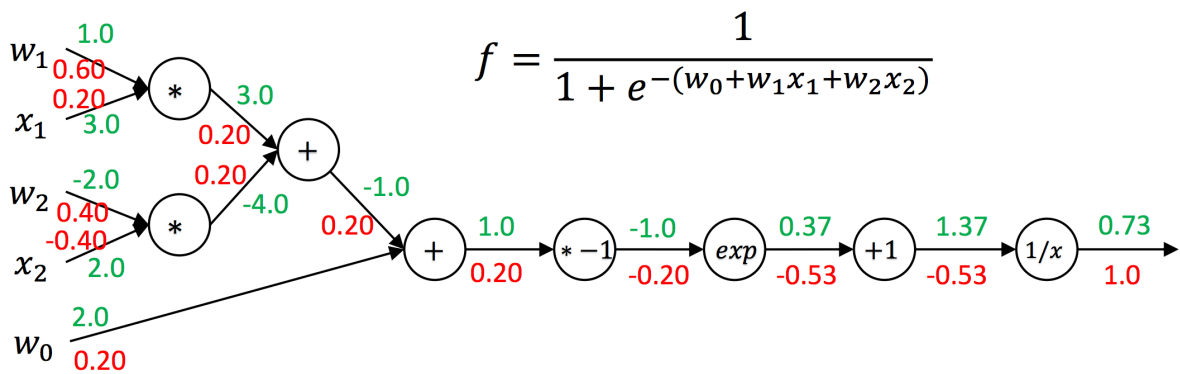


图6: 自动求导, 图来自[AG] P27

从  $1/x$  开始计算出每个点的微分之后, 然后输入为  $1 = \frac{\partial x}{\partial x}$ , 进行逆向计算, 实际效果如下:



从而在  $x_1, x_2$  处分别计算得到  $\frac{\partial J}{\partial w_1}, \frac{\partial J}{\partial w_2}$ 。

计算全部节点符号梯度的伪代码如下:

```
def gradient(out):
    node_to_grad[out] = 1 # 标记尾部节点的梯度为1
    nodes = get_node_list(out) # 获得所有的前向节点
    for node in reverse_topo_order(nodes): # 按照拓扑序逆序遍历节点, 例如上图从1/x
        # 开始, 反向去计算$w_i, i \in \{1, 2\}$
        grad := sum partial adjoints from output edges # 找出多个出边
        input_grads := node.op.gradient(input, grad) for input in node.inputs
        # 计算多个出边的梯度
        add input_grads to node_to_grad # 将多个出边计算的梯度加起来
    return node_to_grad
```

后向传播相对前两种来说, 一次计算就能推导出所有节点的梯度。另外针对具有多条出边的节点, 还可以增加缓存, 来避免多个出边的时候出现重复计算。

对于高阶导数, 典型的深度学习方法是使用Krylov方法, 而不是显式地计算Hessian矩阵。Krylov方法是用于执行各种操作的一组迭代技术, 这些操作包括像近似求解矩阵的逆、或者近似矩阵的特征值或特征向量等, 而不使用矩阵-向量乘法以外的任何操作。

# 主要网络

---

## 单层网络

LR针对连续数据分类，maxsoft针对离散数据分类。

如下：

- 训练：
  - LR

$$\begin{aligned}\hat{y} &= wx + b; \\ l(w, b) &= \frac{1}{2}(\hat{y} - y)^2 \\ w, b &= \underset{w, b}{\operatorname{argmin}} l(w, b)\end{aligned}$$

- maxsoft

$$\begin{aligned}\hat{y} &= wx + b; \\ l(w, b) &= \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n H(y^{(i)}, \hat{y}^{(i)}), H(y, \hat{y}) = - \sum_{j=1}^q y_j^{(i)} \log \hat{y}^{(i)} \\ w, b &= \underset{w, b}{\operatorname{argmin}} l(w, b)\end{aligned}$$

- 预测：  $\hat{y}$

## 多层感知器

引入隐藏层，介于输入和输出层之间，全连接。

- 训练

$$\begin{aligned}
 H &= \phi(XW_H + b_H) \\
 O &= HW_O + b_O \\
 l(W_H, W_O, B_H, B_O) &= \text{SoftmaxCrossEntropyLoss} \\
 W_H, W_O, B_H, B_O &= \underset{w,b}{\operatorname{argmin}} l(W_H, W_O, B_H, B_O)
 \end{aligned}$$

其中激活函数 $\phi$ 包括：

- $\text{relu}(x) = \max(x, 0)$
  - $\text{sigmoid}(x) = \frac{1}{1+\exp(-x)}$
  - $\text{tanh}(x) = \frac{1-\exp(-x)}{1+\exp(-x)}$
- 预测：  $O$

## CNN

## DNN

## 简单总结

CNN在计算机视觉领域应用非常广。借助于卷积层、池化层，借助于填充、步幅以及通道等形式，参考[CNNs], [Book DIDL]给出了常见的卷积神经网络以及各自之间的关系。

RNN对具有序列特性(时间、逻辑等)的数据非常有效，它能挖掘数据中的时序信息以及语义信息，利用了RNN的这种能力，应用在解决语音识别、语言模型、机器翻译以及时序分析等NLP领域。[Book DIDL]有专门的章节介绍各种RNN网络。

相对于CNN每层神经元只能向上一层传播，样本的处理在不同时刻是独立的，RNN的输出可以在下一个时间戳上作用在自身上，也就是第k层神经元在t时刻，除了(k-1)层神经元在该时刻的输出外，还包括了其自身在(t-1)时刻的输出。图示如下：

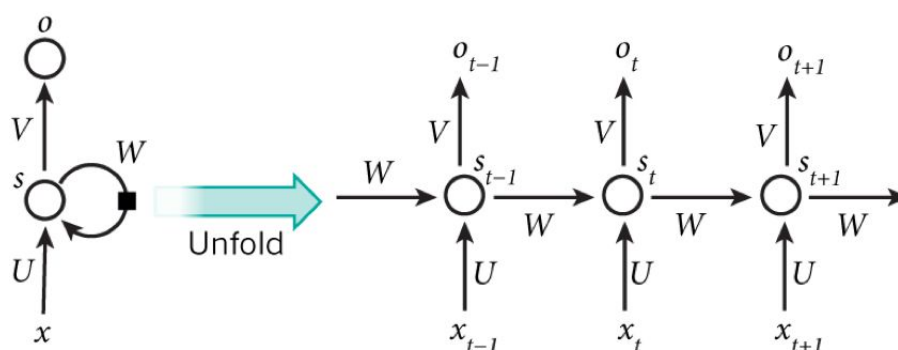


图2： RNN在时间维度上展开，图来自[CNN\_RNN\_DNN]

(t+1)时刻网络的最终结果 $O(t+1)$ 是该时刻输入和所有历史共同作用的结果, 实现某种记忆能力，达到对时间序列建模的目的。例如典型的n-gram语义理解等。

论文[ZLM]也对多层感知器、CNN、RNN之间做了分析和对比。

## 优化方法

优化难点：

- 非凸优化、平坦局部最小值以及鞍点
- 梯度消失和爆炸

由bp算法推动的最后2个步骤得知： $\phi(z)'$ 就是对激活函数求导，如果其求导结果大于1，经过多层计算之后， $\frac{\partial J}{\partial W^{(l)}}$ 就会以指数形式增加，出现梯度爆炸，否则以指数形式递减，形成梯度消失。

- 泛化问题(generalization error): 过拟合问题

## 优化算法

### 学习率调整（含梯度估计修正）

对于正常的梯度下降，设定学习率 $\eta > 0$ ,  $f$ 为连续可导函数，根据泰勒展开，权重矩阵的训练过程如下：

$$W = W - \eta \Delta f(x)$$

1. MBGD: 小批量梯度下降法(mini-batch gradient descent), 从大的训练集里面，分批并且取样进行训练，朝着当前所在位置的坡度最大的方向前进, 在时间步 $t$ ,

$$g_t = \frac{1}{|B|} \sum_{i \in B_t} \Delta f(x)$$
$$W = W - \eta_t g_t$$

2. Momentum: 参照小球在碗中滚动的物理规则进行移动,  $\alpha \in (0, 1)$ , 借助指数加权移动平均使得自变量的更新方向更加一致，从而 可以在开始选择较大的学习率，加速收敛。

$$v_t = \alpha v_{t-1} + \eta_t g_t$$
$$W = W - v_t$$

3. AdaGrad: Ada来自英文单词Adaptive，即“适当的”的意思；AdaGrad会为参数的每个元素适当地调整更新步伐(学习率)，即学习率衰减，随着学习的进行，使学习率逐渐减小，一开始“多”学，然后逐渐“少”学。 $\cdot$ 表示内积。

$$h_t = h_{t-1} + g_t \cdot g_t$$
$$W = W - \frac{\eta}{\sqrt{h_t}} g_t$$

4. RMSProp: 在AdaGrad的基础上,应用指数加权平均.

$$s_t = \alpha s_{t-1} + (1 - \alpha) g_t \cdot g_t$$

$$W = W - \frac{\eta}{\sqrt{h_t}} g_t$$

## 批量大小

批大小会印象随机梯度的方差, 跟泛化能力也相关. 批量大小的选择不宜过大或过小, 需根据实际需求做出选择, 较大的批量可以更准确地估计梯度, 而较小的批量可以获得更快的收敛速度.

## 参数初始化

- 预训/随机/固定值 初始化
- 基于固定方差的初始化: 例如使用高斯分布  $N(0, \sigma^2)$ .
- 基于方差缩放的参数初始化, 例如Xavier初始化
- 正交初始化:  $W$ 初始化为正交矩阵, 满足  $W^{(l)} (W^{(l)})^T = I$ , 使得误差项  $\delta^{(l-1)} = ((W^{(l)})^T) \delta^{(l)}$  满足范数保持性, 即  $\|\delta^{(l-1)}\|^2 = \|\delta^{(l)}\|^2 = \|((W^{(l)})^T) \delta^{(l)}\|^2$ .

## 数据预处理[Book NNDL]

- 最小最大值归一化
- 标准化
- 合并

## 超参数优化[JRYB2011]

常见的超参数有:

1. 网络结构,包括神经元之间的连接关系、层数、每层的神经元数量、激活函数的类型.
2. 批量大小、学习率以及梯度评估方法等
3. 正则化系数等。

常使用随机搜索等方法进行最优组合寻找。

## 网络正则化

### L1/L2正则

$$\theta^* = \arg \min_{\theta} \frac{1}{N} \sum_i \text{Loss}(y^{(n)}, f(x^{(n)}; \theta)) + \lambda l_p(\theta)$$

$l_p$ 为范数。通过添加范数减少过拟合。

### 权重衰减

引入衰减系数 $\beta$ , 在时间步骤t:

$$\theta_t = (1 - \beta) \theta_{t-1} - \alpha g_t$$

### 丢弃法



是指在训练一个深度神经网络时，我们可以随机丢弃一部分神经元来避免过拟合，每次选择丢弃的神经元是随机的。

# 库和框架

## 深度学习库对比

### Keras

[Keras](#) 是提供了高度抽象的深度学习API，依赖于TensorFlow进行部署和分布式训练。提供了丰富的数据预处理和网络配置功能，支持多种框架上运行，实现端到端的深度学习。

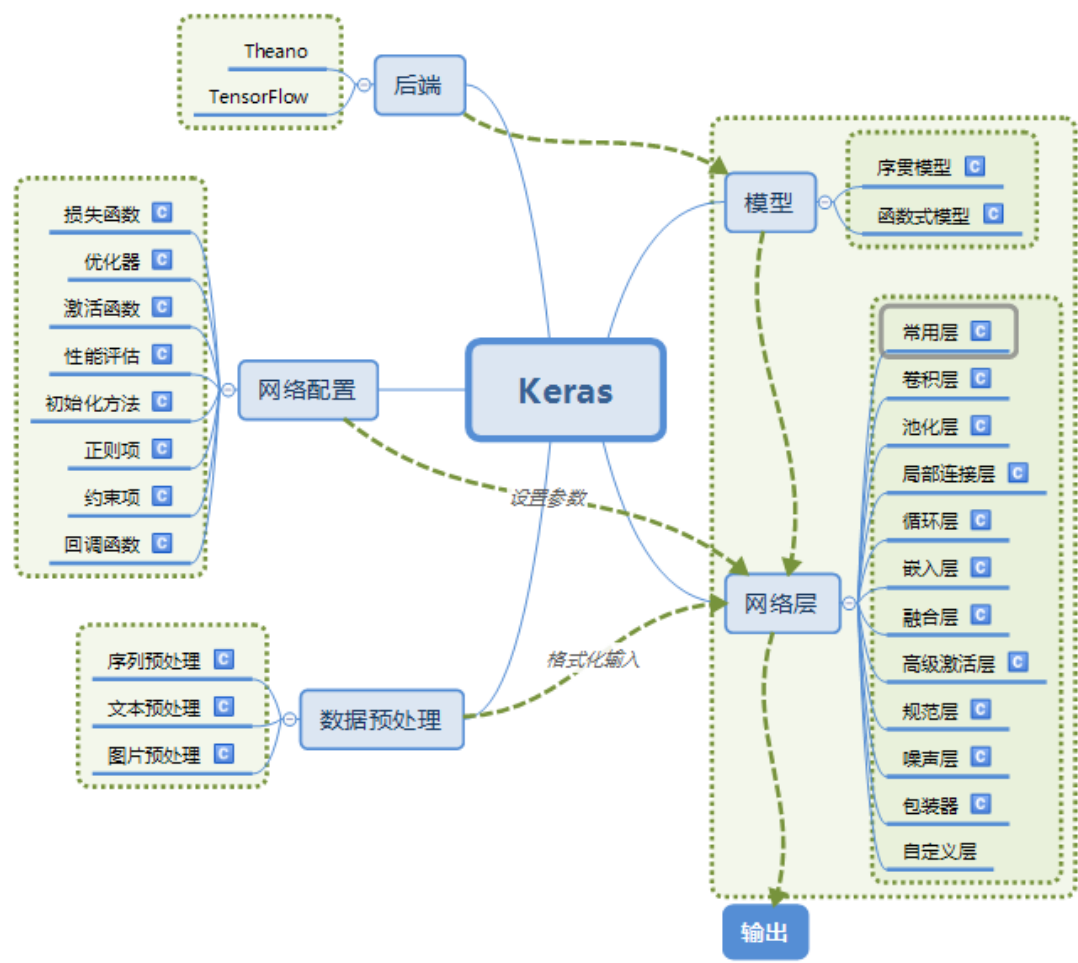


图2： Keras模块结构, 图来自[Keras\_Intro]

layers的具体介绍参考[layers](#).

构建网络步骤：

1. 预处理： `TextVectorization|Normalization`， 调用adapt进行实际的预处理
2. 构建网络层：
  1. 支持的Model
    - Sequential: `keras.Sequential()`, a linear stock of layers;
    - Functional: `keras.Model(inputs=[input_], outputs=[output])`, a graph of layers as

nodes.

2. Layer: Input|Dense|Conv2D|MaxPooling|Output|custom

3. 编译: `compile(optimizer = SGD|RMSprop|Adam...,  
loss=MeanSquaredError|KLDivergence|CosineSimilarity..., metrics=[AUC...])`

4. 训练: `fit(x, y, batch_size, epochs, validation_data...)`

5. 预测: `predict(x)`

## PyTorch

[PyTorch](#)本身算是一个深度学习框架，同时也提供了支持GPU的Tensor计算库和神经网络库，相对其他深度学习库，支持[动态计算图](#)。相对静态计算图(computational graph, 节点为张量，边为运算(Function, 卷积、基本运算等))，先搭建图然后运算，动态图是运算与搭建同时进行，更为灵活，但是效率相对较低。

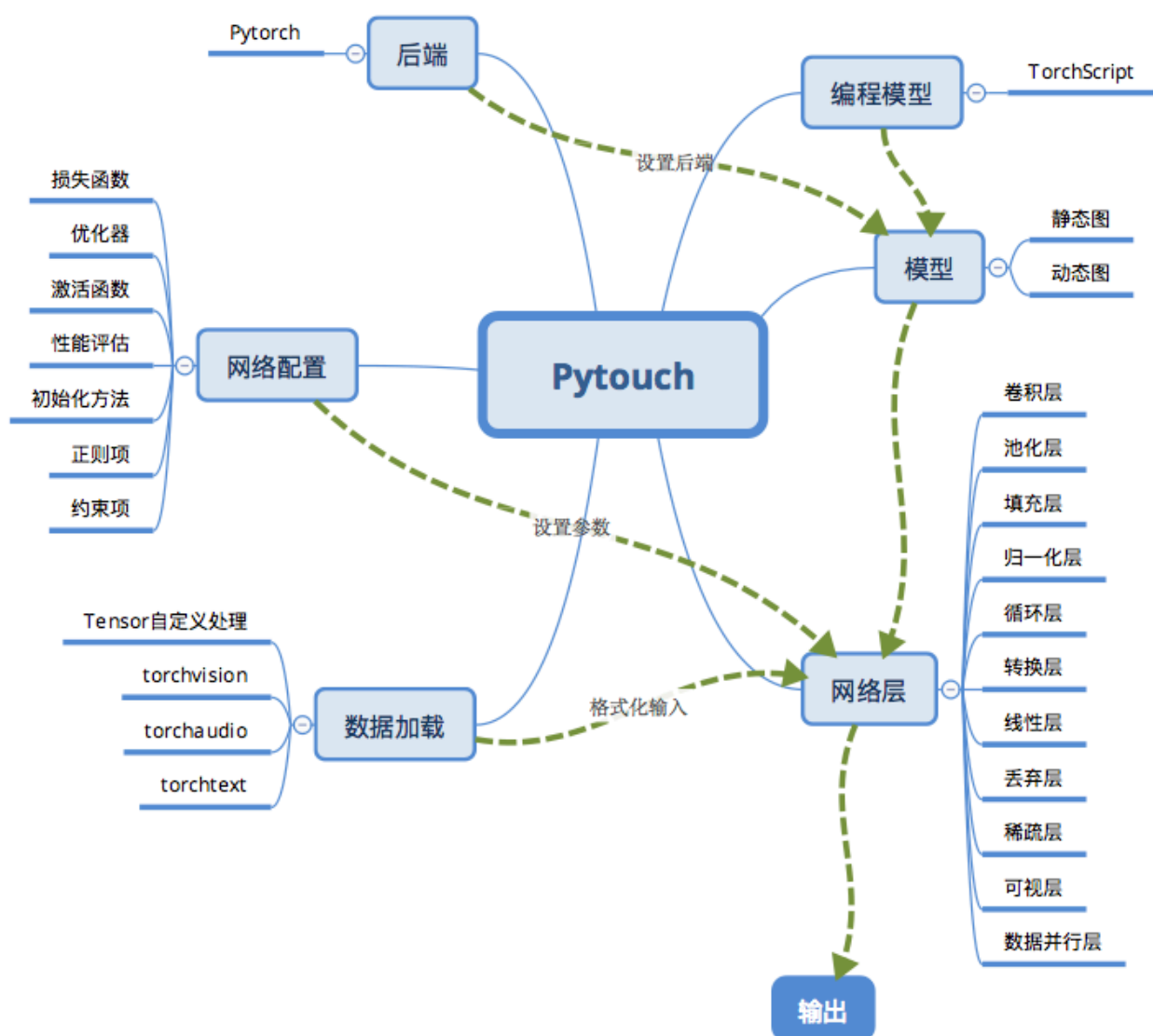


图3：Pytorch模块结构

构建网络步骤：

1. 通过torchvision等进行数据加载;
2. 构建网络, 继承nn.Module, 定义layers;
  1. Layer: torch.Linear | Conv2D | custom
  2. 在输入数据集上迭代 torch.functional.forward;
  3. 定义损失函数和优化器;
3. 训练:
  1. 通过网络处理输入,进行梯度反向传播:

```
net.zero_grad()  
out.backward(torch.randn(1, 10))
```

2. 定义并且计算loss(输出和正确答案的距离) 例如选择 `MSELoss`, 然后调用 `loss.backward`;

```
output = net(input)  
target = torch.randn(10)  # 本例子中使用模拟数据  
target = target.view(1, -1)  # 使目标值与数据值尺寸一致  
criterion = nn.MSELoss()  
  
loss = criterion(output, target)  
  
net.zero_grad()      # 清零所有参数(parameter) 的梯度缓存  
loss.backward()
```

3. 将梯度反向传播给网络的参数,更新网络的权重:

```
# 创建优化器(optimizer)  
optimizer = optim.SGD(net.parameters(), lr=0.01)  
  
# 在训练的迭代中:  
optimizer.zero_grad()  # 清零梯度缓存  
output = net(input)  
loss = criterion(output, target)  
loss.backward()  
optimizer.step()      # 更新参数
```

4. 预测: `net(test_x)`

简单总结: Keras和PyTorch的对比参考[Keras\_vs\_PyTorch]. PyTorch更加灵活, 可定制程度高, Debug能力强, 同时效率也较高, 社区更活跃, 适合research, Keras抽象程度高, 适合新手入门, 对小数据集和快速原型搭建非常适合。

## 深度学习框架对比

通过文献[GSMVAPL] 我们可以大概了解目前深度学习库和框架之间的大概关系:

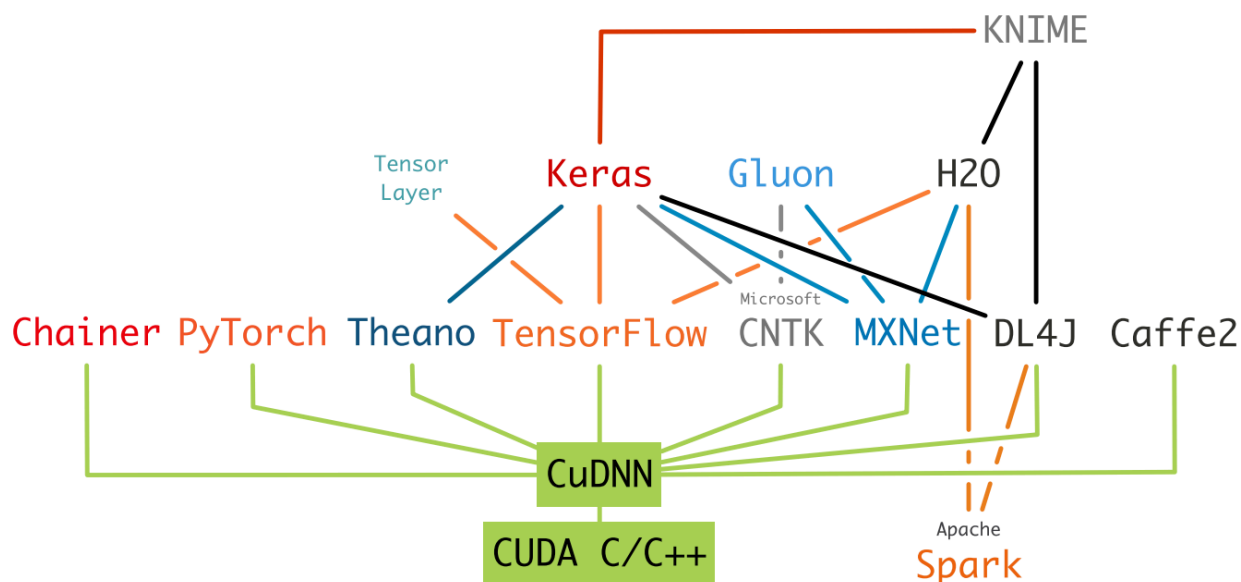


图4：流行深度学习框架和库的层次关系

这里我们只关注框架。

[GSMVAPL] P100-101对当前主要机器学习框架和库从licence、开发语言、计算图支持情况、API语言以及流行度、使用场景和项目发起者进行了分析，最流行的框架是TensorFlow，开发语言基本上是c++或者python，只有TensorFlow、PyTorch以及MXNet和Chainer支持动态图，同时基本所有框架都支持Python API. 最后可以看到大部分框架都是由大厂牵头研发的，人力和财力投入巨大。

从性能方面来看，没有一个框架在所有的场景和案例下面都绝对领先于其他框架。从文献[YCWSWQ]可以看到，不同的超参对性能和精确度都有非常大的影响。

## 参考

[Book PDSH] : Python Data Science Handbook

[CS229] : <https://see.stanford.edu/Course/CS229>

[JRYB2011] : [Algorithms for Hyper-Parameter Optimization](#)

[Book DLP] : Deep Learning with Python

[Book DIDL] : Diving Into Deep Learning

[Book NNDL] : <https://nndl.github.io/> , 总结: <https://zhuanlan.zhihu.com/p/162943650>

[Keras\_Intro] : [https://blog.csdn.net/zdy0\\_2004/article/details/74736656](https://blog.csdn.net/zdy0_2004/article/details/74736656)

[Keras\_vs\_PyTorch] : <https://deepsense.ai/keras-or-pytorch/>

[DL\_framework] : <https://www.zhihu.com/question/46587833/answer/104288698>

[GSMVAPL] : [Machine Learning and Deep Learning frameworks and libraries for large-scale data mining: a survey](#), Artificial Intelligence Review(2019), 77-124

[YCWSWQ] : [A Comparative Measurement Study of Deep Learning as a Service Framework](#)

[CNNs] : <https://zhuanlan.zhihu.com/p/47391705>

[CNN\_RNN\_DNN] <https://www.zhihu.com/question/34681168/answer/84061846>

[ZLM]: 张荣. et.al 《深度学习研究综述》, 2018 《信息与控制》 385-397. <https://arxiv.org/pdf/1804.01653.pdf>

[COCG] <http://colah.github.io/posts/2015-08-Backprop/>

[AG] <http://dlsys.cs.washington.edu/pdf/lecture4.pdf>