Trabalho 3: Aprendizado de Máquina – Aprendizado Supervisionado

Fase 1: Análise de Correlação e Regressão Linear

Este trabalho visa entender a natureza da relação linear entre os dados. Faremos a análise de *correlação*, que é utilizada para medir a intensidade de associação de duas variáveis (Relação Linear), e, também a análise de *regressão*, que é utilizada para prever valores de uma variável dados os valores de outra. A correlação foca primeiramente na associação, enquanto a regressão é designada para ajudar a fazer previsões.

Considere os três grupos de dados (datasets) a seguir:

```
x1 = [10;8;13;9;11;14;6;4;12;7;5];
y1 = [8.04;6.95;7.58;8.81;8.33;9.96;7.24;4.26;10.84;4.82;5.68];

x2 = [10;8;13;9;11;14;6;4;12;7;5];
y2 = [9.14;8.14;8.47;8.77;9.26;8.10;6.13;3.10;9.13;7.26;4.74];

x3 = [8;8;8;8;8;8;8;8;8;8;19];
y3 = [6.58;5.76;7.71;8.84;8.47;7.04;5.25;5.56;7.91;6.89;12.50];
```

A melhor maneira para visualizar a relação entre os dados é gerando um Gráfico(Diagrama) de Dispersão (utilize o comando Octave *scatter*). O Gráfico de Dispersão representam o quanto uma variável é afetada por outra.

A correlação mede a direção e intensidade da relação linear. O coeficiente da correlação **r** entre as variáveis **x** e **y** são calculadas com a seguinte equação:

$$r = \frac{\Sigma(x-\bar{x})(y-\bar{y})}{\sqrt{(\Sigma(x-\bar{x})^2\ \Sigma(y-\bar{y})^2)}}$$

A reta da regressão é definida por:

$$\hat{y} = \beta_0 + \beta_1 x$$

Onde,

$$\beta_0 = \bar{y} - \beta_1 \bar{x}$$

$$\beta_1 = \frac{\Sigma(x-\bar{x})(y-\bar{y})}{\Sigma(x-\bar{x})^2}$$

1) Implemente duas funções chamadas **correlacao.m** e **regressao.m**. Cada uma deve ter dois vetores Nx1 como entrada, onde N é a dimensão do vetor (no caso de x N=11). A primeira

função deve calcular o coeficiente de correlação r, e a segunda função deve calcular a regressão, isto é, $\beta\mathbf{0}$ e $\beta\mathbf{1}$.

2) Faça um script no Octave chamado **demo.m** onde para cada dataset faça os seguintes comandos:
   a. Faça um Gráfico de Dispersão (veja função ***Scatter***).
   b. Calcule o coeficiente de correlação.
   c. Trace a linha da regressão no Gráfico de Dispersão (utilize a função **hold on** para isto)
   d. Mostre os coeficientes de correlação e regressão no Gráfico de Dispersão (utilize as funções ***title*** e ***num2str***)
   e. Compare seus resultados com as funções Octave ***corr*** e ***glmfit*.**

3) Qual dos datasets não é apropriado para regressão linear?

Fase 2: Análise de Regressão Linear Multipla

Agora, em vez de uma variável independente x (por exemplo, quando nós modelamos o preço da casa com base apenas em seu tamanho), vamos considerar múltiplas variáveis independentes x1, x2, ... xN. Com isso, iremos prever preço da casa com base em seu tamanho e número de quartos.

Neste caso, a linha de regressão é:

$$y = \beta_0 + \beta_1 X_{i\,1} + \beta_2 X_{i\,2} + \ldots + \beta_n X_{i\,n}$$

Onde a Matriz X é definida como:

$$X = \begin{pmatrix} 1 & X_{11} & X_{12} & \cdots & X_{1N} \\ 1 & X_{21} & X_{22} & \cdots & X_{2N} \\ . & . & . & \cdots & . \\ 1 & X_{m1} & X_{m2} & \cdots & X_{mN} \end{pmatrix}$$

Deste modo, podemos definir a linha de regressão de uma forma mais simples:

$$\hat{y} = X * \beta$$

A expressão para os parâmetros do modelo β é:

$$\beta = (X^t X)^{-1} X^t y$$

Semelhante à fase anterior, você deve implementar a função **regmultipla.m** que calcula os parâmetros β para o dados de entrada y e X. Faça um script **rmdemo.m** que faz o seguinte:

a) Baixe os dados do arquivo **data.mat** (para isso, você pode usar a função **load**). A primeira coluna é o tamanho da casa, a segunda coluna é o número de quartos, e a terceira coluna é o preço da casa.

b) Gere uma matriz X para as variáveis independentes (que são o tamanho da casa e o número de quartos) e o vetor y da variável dependente (que é o preço).
c) Verifique a correlação e a regressão para **Tamanho da casa** e **Preço** e **Número de quartos** e **Preço**.
d) Faça o gráfico (diagrama) de dispersão dos dados. Neste caso iremos trabalhar com o espaço 3D (verifique a função scatter3).
e) Trace a linha da regressão no Gráfico de Dispersão (verifique a função plot3). Você pode girar este gráfico utilizando a seta de rotação.
f) Mostre na figura os coeficientes de correlação entre **Tamanho da casa** e **Preço** e **Número de quartos** e **Preço**.
g) Calcule o preço de uma casa que tem tamanho de 1650 e 3 quartos. O resultado deve ser igual a 293081.
h) Compare seus resultados com a função Octave **regress**. Por favor, tenha muito cuidado com os parâmetros de entrada para esta função.

Fase 3: Regressão Polinomial - Overfitting

Nesta fase iremos considerar a Regressão Polinomial com uma variável x. A Regressão Polinomial encaixa uma relação não linear entre o valor de x e o valor correspondente de y. Neste caso a fórmula geral da Regressão Polinomial é:

$$y = \beta_0 + \beta_1 X + \beta_2 X^2 + \beta_3 X^3 + \ldots + \beta_N X^N$$

e podemos definir a matriz X como:

$$X = \begin{pmatrix} 1 & X_1 & X_1^2 & X_1^3 & \cdots & X_1^N \\ 1 & X_2^2 & X_2^2 & X_2^3 & \cdots & X_2^N \\ . & . & . & . & \cdots & . \\ 1 & X_m & X_m^2 & X_m^3 & \cdots & X_m^N \end{pmatrix}$$

e a linha de regressão pode ser reescrita como:

$$y = X\beta$$

Desta vez, para calular o valor de β use a função **polyfit**. Você deverá verificar o que acontece quando vamos aumentamos o grau de um polinômio, ou seja, quando consideramos N = 1, 2, 3 ...

Faça um script **demo_regressaop.m** que faz o seguinte:

a) Baixe o arquivo **data_preg.mat**. A primeira coluna representa os valores de x e a segunda coluna representa os valores de y.

b) Faça o Gráfico de dispersão dos dados.

c) Use a função **polyfit** para gerar a linha de regressão para N = 1 e trace-o no gráfico de dispersão na cor vermelha (plot (x, y, 'r')). (observe que nesta função a numeração coeficiente é invertida! $\beta_0=\beta_N$, $\beta_1=\beta_{N-1}$, $\beta_2=\beta_{N-2}$, ...$\beta_N=\beta_0$)

d) Trace a linha de regressão para N = 2 no gráfico na cor verde.

e) Trace a linha de regressão para N = 3 no gráfico na cor preta.

f) Trace a linha de regressão para N = 8 no gráfico na cor amarela.

g) Calcule o Erro Quadrático Médio (EQM) para cada linha de regressão. Qual é o mais preciso?

h) Para evitar o overfitting, divida os dados aleatoriamente em Dados de Treinamento e Dados de Teste. Use os primeiros 10% dos dados como conjunto de teste, e o resto como de treinamento.

i) Repita os passos de **c - f**, mas agora use **apenas os dados de treinamento** para ajustar a linha de regressão.

J) Repita o passo **g**, mas agora utilize **somente os dados de Teste** para calcular o erro.

k) Que método é o mais preciso neste caso?

Observações:

- Envie um total de 3 funções: **correlacao.m**, **regressao.m, regmultipla.m** e 3 scripts: **demo.m, rmdemo.m, demo_regressaop.m** (todas com comentários do que foi feito), e responda as perguntas nos comentários de cada script.
- Coloque o nome dos integrantes do grupo na primeira linha das funções e scripts.
- Envie apenas uma versão para todo o grupo, especificando também os nomes de todos os outros colegas.
    - T3_Aluno1_Aluno2_Aluno3.zip