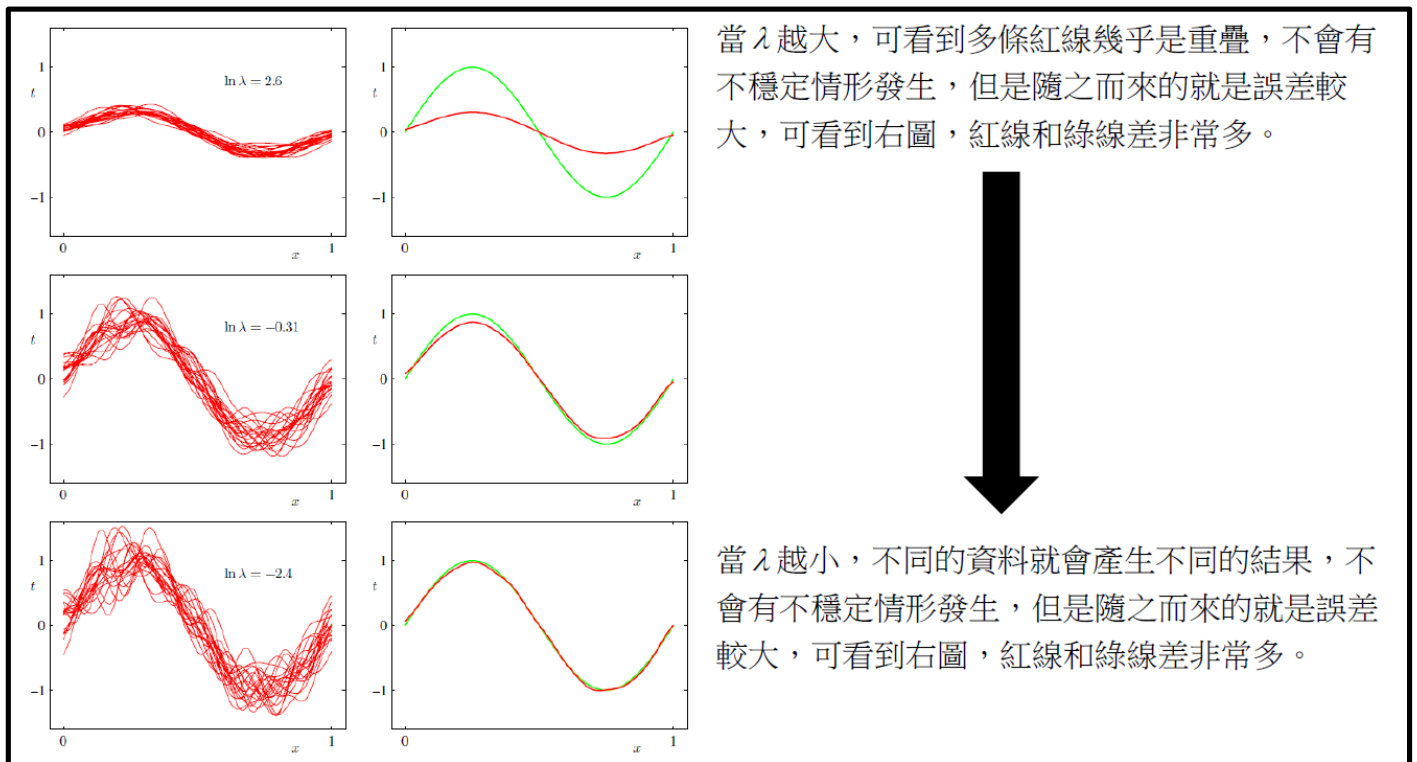


Bias 與 variance 之間的權衡

若是我們希望 **bias** 小，也就是我們算出來的參數要和母體參數的誤差要很小，常常會讓 **variance** 很大，換句話說，就是 **sensitivity** 很高，容易因為幾筆數據的不同而讓結果有大幅度的改變，又或是我們重複執行試驗數次，可能每一次得到的結果都不太一樣。

之前我們也有拿課本的圖說明這樣的概念



當然的，我們希望母體的參數和我們推得的越接近越好，也就是 $\min(E(\hat{\theta} - \theta)^2)$ ，在這之後我們

令 $MSE(\hat{\theta}) = E(\hat{\theta} - \theta)^2$ ，希望找到使得 $MSE(\hat{\theta})$ 最小的 $\hat{\theta}$

但是，我們推算參數時，其實我們是不知到母體參數的，如果知道的話，我們就直接用母體參數了，幹嘛還要那麼累推導那麼多 XD(就像如果我已經知道全球的男女比，我幹嘛還要慢慢抽樣去推算)，所以這個方法其實是不管用的。

接下來要推導的，就是最佳的 **MSE** 不是在最小的 **bias** 或是最小 **variance** 的地方，所以 **bias** 不是越小越好，**variance** 也是一樣。

note:

MSE 和 **bias** 有些許不同， $MSE(\hat{\theta}) = E(\hat{\theta} - \theta)^2$ ，是母體參數和估計參數差值的平方的期望值，

$bias = \theta - E(\hat{\theta})$ ，是母體參數和估計參數期望值的差

Bias- variance decomposition

$$\begin{aligned}E(\hat{\theta} - \theta)^2 \\&= E((\hat{\theta} - E(\theta)) - (\theta - E(\theta)))^2 \\&= E((\hat{\theta} - E(\theta))^2 - 2(\hat{\theta} - E(\theta))(\theta - E(\theta)) + (\theta - E(\theta))^2)\end{aligned}$$

我們將第二項單獨拿出來看

$$\begin{aligned}2(\hat{\theta} - E(\theta))(\theta - E(\theta)) \\&= 2(\theta - E(\theta))E(\hat{\theta} - E(\theta)) = 2(\theta - E(\theta))(E(\hat{\theta}) - E(E(\theta)))\end{aligned}$$

這裡的 $E(\theta)$ 可想成之前的 μ ，則 $E(\hat{\mu}) = \mu$, $E(E(\mu)) = E(\mu) = \mu$

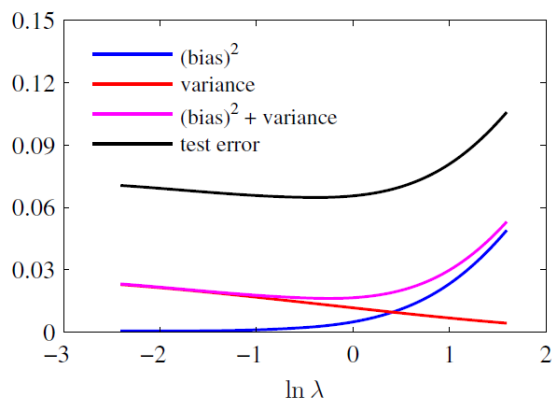
故

$$\begin{aligned}2(\hat{\theta} - E(\theta))(\theta - E(\theta)) \\&= 2(\theta - E(\theta))(E(\hat{\theta}) - E(E(\theta))) \\&= 2(\theta - E(\theta))(E(\theta) - E(\theta)) = 0\end{aligned}$$

故

$$\begin{aligned}E(\hat{\theta} - \theta)^2 &= E((\hat{\theta} - E(\theta))^2 - 2(\hat{\theta} - E(\theta))(\theta - E(\theta)) + (\theta - E(\theta))^2) \\&= E(\hat{\theta} - E(\theta))^2 + E(\theta - E(\theta))^2 \\&= E(\hat{\theta} - E(\hat{\theta}))^2 + E(\theta - E(\hat{\theta}))^2 \\&= \text{variance}(\hat{\theta}) + \text{bias}^2(\hat{\theta})\end{aligned}$$

我們試著透過增大 λ 來觀察上式中 **variance** 和 **bias** 的關係



課本 p151

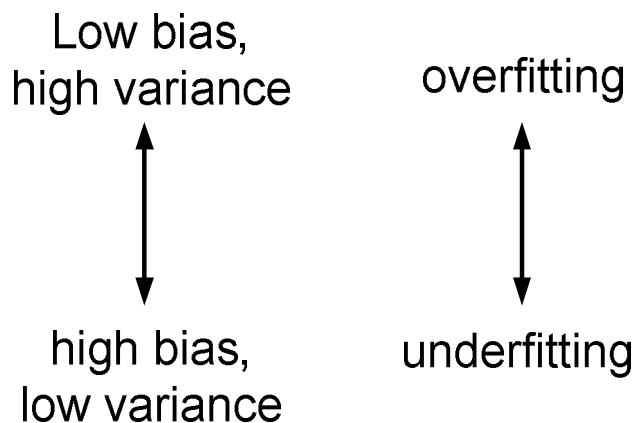
當加大 λ 時，因為 $\lambda = \frac{b}{a}$ ，當然的 a ，也就是 **variance** 會變小，而當 **variance** 變小時，**bias** 隨

之而來的會變大，而帶入上面的公式時，我們剛剛推得的 **MSE** 和實際的 **test error** 是吻合的！

note:

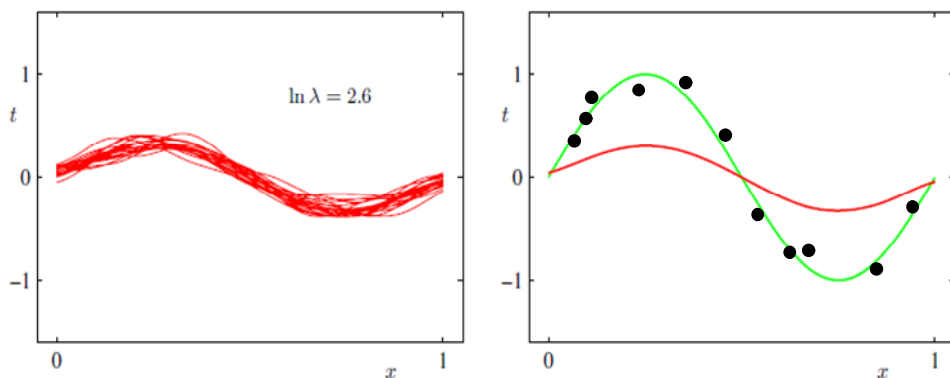
由上式推導我們可知道，雖然我們沒辦法直接得到最小的 **MSE**，但如果我們將 **variance**，像是 **lesson10-11** 時我們給予的參數 **a**，通常我們可以給予我們估計的 **model variance**，有些人可能就會有些疑惑，給 **a=0** 不是最好嗎？如果我們持續做 **online learning**，通常到最後收斂時 **variance** 都會接近 **0**，這樣對於我們估計出來的模型應該是很有信心的啊！怎麼可能會有人沒事假設一個很大的 **a**，讓最後就算收斂了，我們的信心仍然不足。前面也解釋過了，通常給予較小的 **variance** 會造成較大的 **bias**，但是較大的 **bias** 不見得是壞事，像上圖所示，最佳的 **MSE** 落在的區間不是最小的 **variance** 或是最小的 **bias**，而是要有所折衷。

Bias variance tradeoff



underfitting

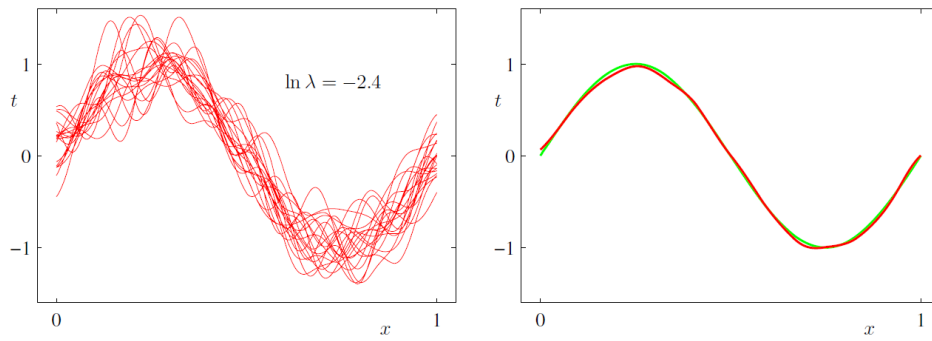
訓練出來的 **model** 連自身的 **test data** 都有著很大的誤差，就像是下圖的 **case**，**train data** 是黑點，當發生 **underfitting** 時，**train** 出來的結果如左圖，連本身的 **train data** 誤差都極大



overfitting

訓練出來的結果太貼近自身的 **test data**，下圖是因為取樣點夠多，所以不會發生 **overfitting** 的

現象，否則若是取樣點不夠，會離我們理想的 **model** 差距很大。



low bias:

e.g. LSE, k-nn algorithm

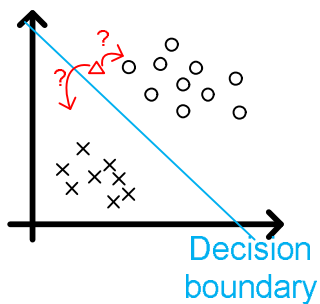
low variance:

e.g. rLSE, Naïve bayes classifier

classification

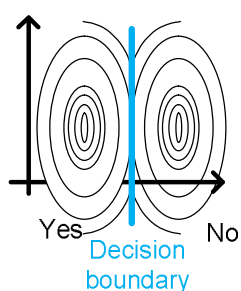
我們等會會說明，分類其實就是在做 **regression**

decision boundary



決定一個新 **data** 是在哪一個分類的依據，若是在 的左半邊就屬於 **X** 分類，若在 右半邊就屬於 **O** 分類。

e.g. Naïve bayes 分類器就是一個很顯著的例子



在 **decision boundary** 上的點，無法分類其為哪一類，因為屬於兩類的機率皆相同

Confusion matrix

用來分類各種分類的狀況，以表達分類的準確性，不只是分類分析的準不準而已，還分成四種狀況

		實際	
		YES (positive)	NO (negative)
預測	YES	true positive(TP)	false positive(FP)
	NO	false negative(FN)	true negative(TN)

true/false 代表預測的成功與否

positive/negative 代表預測發生的情形為何

分析的準確性有兩種指標，**sensitivity** 及 **specificity**

sensitivity 指的是所有實際為 **yes** 的結果中，有多少被我們判斷出來，也就是 $\frac{TP}{TP + FN}$

specificity 指的是我們將實際為 **no** 的結果判斷錯誤的機率，也就是 $\frac{FP}{FP + TN}$

ROC 空間

ROC curve 是可以用肉眼就看出分類的準確性的圖，**X 軸**是偽陽性率(**false positive rate**)，也就是預測為 **Yes** 但預測錯誤的機率，又稱為假警報率，就是上面提的 **specificity**。**Y 軸**為真陽性率(**true positive rate**)，又稱為敏感度(**sensitivity**)，我們在意的都只是實際上預測的狀況，所以分母都是實際狀況。

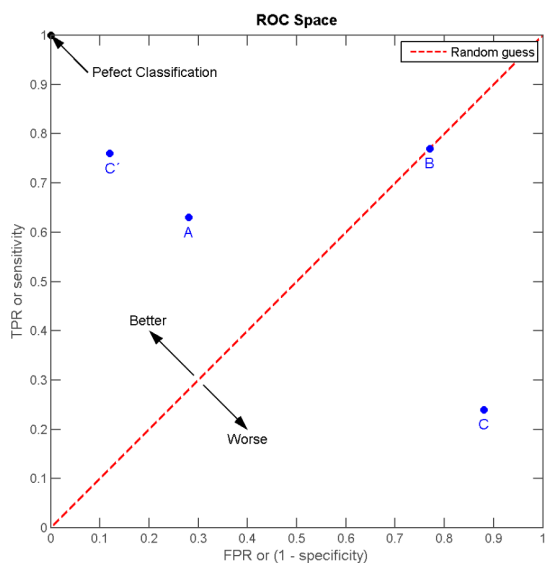
X 軸越小，**Y 軸**越大，代表我們預測的準確率越高，**X 軸**越小代表我們越不容易將實際為 **NO** 的事件預測為 **YES**，**Y 軸**越大代表我們越容易將實際為 **YES** 的事件預測為 **YES**。故在圖表中越左上角代表預測越準確。如果在最左上角，代表完美預測。

我們會將 **ROC curve** 圖做一(0,0)到(1,1)的對角線，越左上角代表預測越準確，越右下角代表越不準確，若是落在對角線上，代表完全沒有識別率(也就是你是亂猜的)。

例子我懶得想，直接拿維基百科的例子來看

A			B			C			C'		
TP=63	FP=28	91	TP=77	FP=77	154	TP=24	FP=88	112	TP=76	FP=12	88
FN=37	TN=72	109	FN=23	TN=23	46	FN=76	TN=12	88	FN=24	TN=88	112
100	100	200	100	100	200	100	100	200	100	100	200
TPR = 0.63			TPR = 0.77			TPR = 0.24			TPR = 0.76		
FPR = 0.28			FPR = 0.77			FPR = 0.88			FPR = 0.12		
ACC = 0.68			ACC = 0.50			ACC = 0.18			ACC = 0.82		

將各點對應到 ROC 空間中如下圖



A 有最佳的識別率，B 完全沒識別率，C 有最差的識別率，但是如果我們將 C 每次的預測結果反過來看，其擁有最佳的識別率，所以 C 也是算有識別率的(就像是我們常講的反指標)。

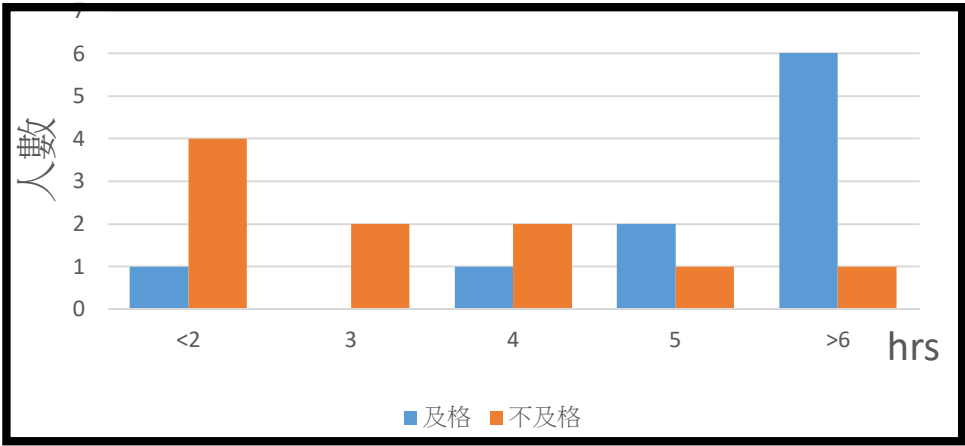
ROC curve

我們常常喜歡用一個閾值(threshold)來區隔發生事件的歸類，例如一天喝 6000c.c. 以上的水會水中毒，BMI 超過多少就是過胖...，ROC 就是利用閾值的不同，來判斷我們預測採用的方法是不是好的。

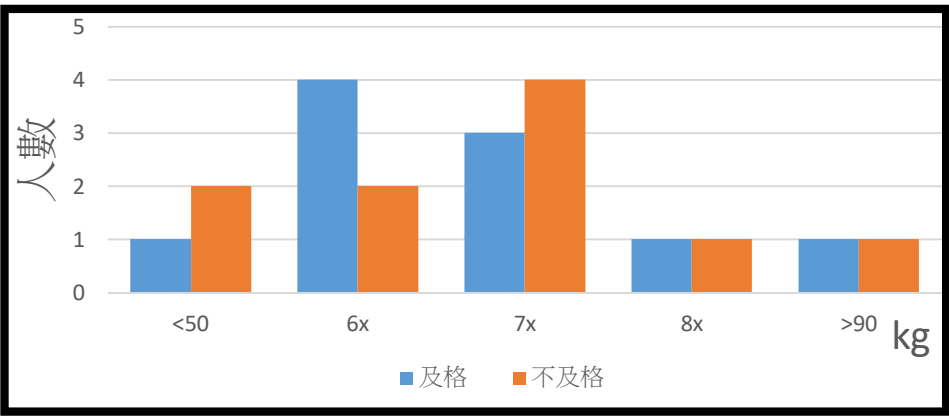
以下舉個例子應該會比較好懂

假設我們有兩個方法預測一個學生考試成績好不好，一個是花在讀書方面的時間，一個是該學生的體重。我們找十個考試及格和十個考試不及格的學生來做測試。

以讀書時間來看



以體重來看

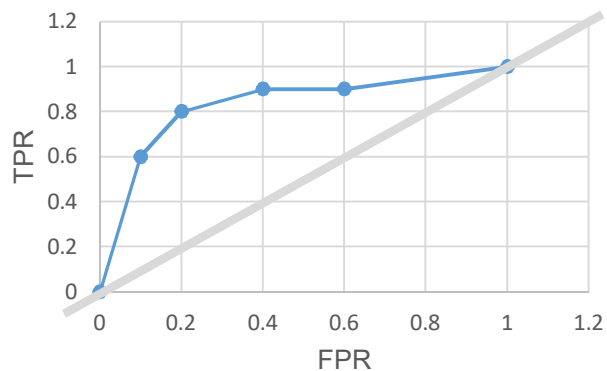


我們可以針對不同的閥值繪製出一張 ROC curve，例如以讀書時間來做預測為例，假定我們定義”只要一天讀書 4 小時以上就一定可以及格”，這樣的預測可得到 TPR 為 0.9，FPR 為 0.4，

我們將讀書時間閥值從<2 小時一直做到>6 小時，可得到下表

	TPR	FPR
<2	1	1
3	0.9	0.6
4	0.9	0.4
5	0.8	0.2
>6	0.6	0.1
>10	0	0

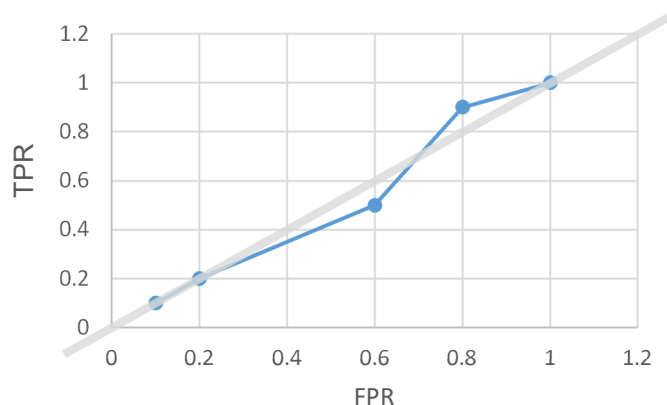
可得到 ROC curve



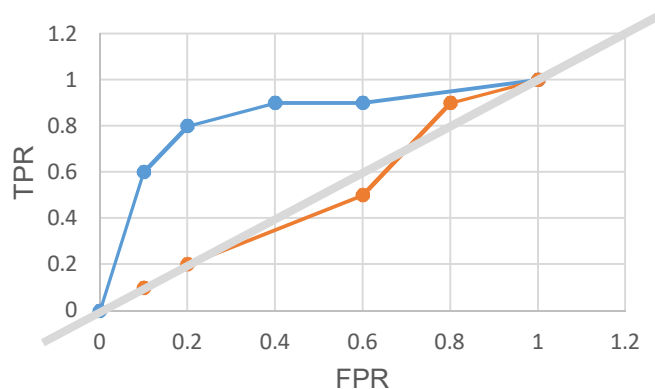
我們再做體重閾值的 ROC

先得下表

	TPR	FPR
<50	1	1
6x	0.9	0.8
7x	0.5	0.6
8x	0.2	0.2
>90	0.1	0.1
>120	0	0



我們將兩者因素結果疊起來



我們要如何判斷哪種判別標準比較好，就是使用 AUC(area under the curve of ROC)

AUC 是判別一個判別哪種標準正確率較好的標準，像是上圖，使用讀書時間得到的 AUC 比體重得

到的 AUC 還要高，故採用讀書時間的標準比較準確。

Regression -> classification

這邊描述的是 supervise learning(監督學習)，所謂的監督學習就是給予每個 train data 一個 label 供分類

one-coding

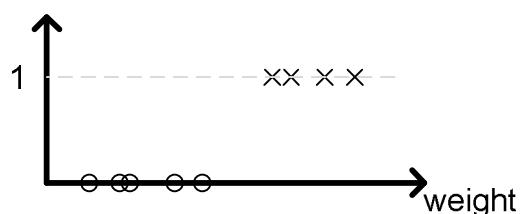
one dimension

e.g.

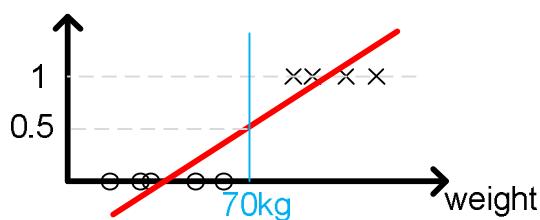
我們想分別男生和女生，以體重來做區分



將男生視為 label 1，女生視為 label 0(就是所謂的 indicator function)得



我們將上圖做 LSE，再找出 LSE 直線中縱軸為 0.5 的 weight，該 weight 為 decision boundary

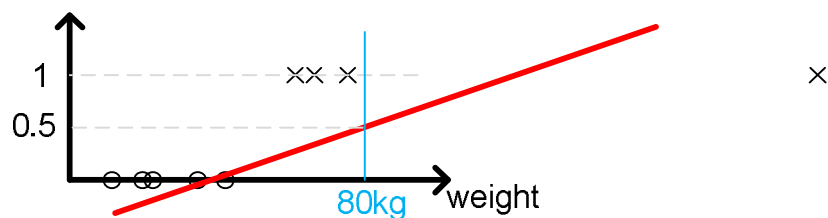


我們就可以歸納出 >70kg 是男生這個結論，在目前的 test case 下看起來也沒甚麼問題

缺點：

易受極端值影響，容易使 LSE 直線偏移而使得 decision boundary 偏移。

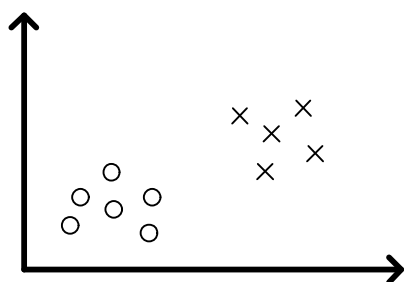
e.g.



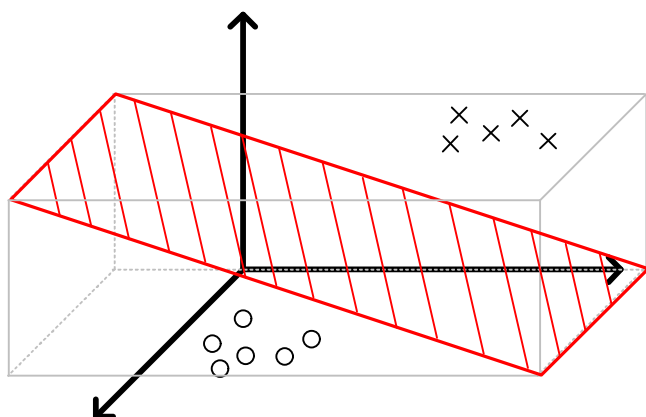
如果我們歸納出“>80kg 才是男生”，那麼 **test case** 下就有三個男生被我們歸類錯誤

two dimension

其實沒啥大不了的，做個延伸而已



加入 indicator function



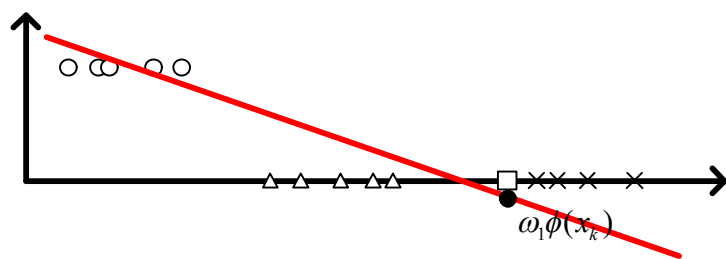
one-k-coding

一次分類 k 個群組，我們一樣可以使用 **one-coding** 的方式，我們只需要分類其中一群組和其他所有群組，有 k 個群組，我們就需做 $\binom{k}{2}$ 次

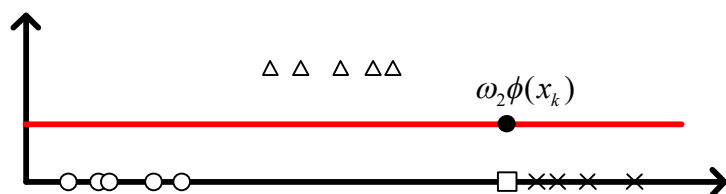
e.g.



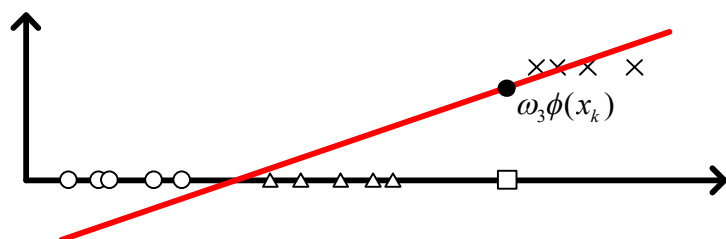
找分類 O



找分類 Δ



找分類 X



而□的最佳分類為 $\arg \max_a (\omega_a \phi(x_k))$ ，像是此例中□最佳分類為 X

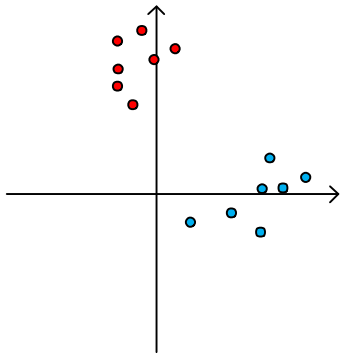
loss function

由於有易受極端值影響的缺點，故有多種不同的 loss function 被發明出來

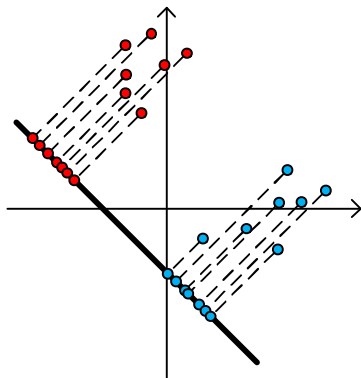
Fisher Linear Discriminant

又稱為 LDA(linear discriminant analysis)，是一種降維的分類方法，我會先說明他的概念，後面會有數學推導，數學推導上課沒講，有興趣再看就好

先來看一張圖



我們希望將這兩種顏色的點分群，**Fisher Linear discriminant** 是找出一個映射面，使得所有點映射到該面上後，相同的分類的點能夠盡可能靠近，不同的分群的點能夠盡可能疏離。下圖中的黑色粗線就是我們希望得到的映射面。



此映射面其實是某個空間的 **eigenvector**，下面就會推導該如何得到該映射平面，有興趣再看

Step1

我們的目標是找到一參數 w ，則 Xw 為映射後的新平面，令 $y = xw$

我們希望將資料分成兩類，故我們需要能代表兩個分類的參數，這裡我們使用的是該分類的平均值

$$m_i = \frac{1}{n_i} \sum_{x \in D_i} x$$

m_i 為第 i 類的 **mean**， D_i 為該分類的集合

而投影後的平均值可表示為

$$\overline{m_i} = \frac{1}{n_i} \sum_{y \in Y_i} y = \frac{1}{n_i} \sum_{x \in D_i} xw = \left(\frac{1}{n_i} \sum_{x \in D_i} x \right) w = m_i w$$

Y_i 為第 i 類經過投影後的資料點集合

Step2

我們希望同一分類中的點越集中越好，直覺上就是分類中的點的 **variance** 越小越好，分類中的 **variance** 可表示為

$$\sigma_i^2 = \sum_{y \in Y_i} (y - \bar{m}_i)^2$$

同時，我們也希望兩個分類越遠越好，故我們希望最大化 $|\bar{m}_1 - \bar{m}_2| = |m_1 w - m_2 w| = |(m_1 - m_2)w|$

我們將希望最大化的放分子，最小化的放分母，定義出一新的函式 $J(w)$

$$\begin{aligned} J(w) &= \frac{|\bar{m}_1 - \bar{m}_2|^2}{\sigma_1^2 + \sigma_2^2} = \frac{|(m_1 - m_2)w|^2}{\sum_{y \in Y_1} (y - \bar{m}_1)^2 + \sum_{y \in Y_2} (y - \bar{m}_2)^2} = \frac{((m_1 - m_2)w)^T ((m_1 - m_2)w)}{\sum_{x \in D_1} (xw - m_1 w)^2 + \sum_{x \in D_2} (xw - m_2 w)^2} \\ &= \frac{w^T (m_1 - m_2)^T (m_1 - m_2) w}{\sum_{x \in D_1} w^T (x - m_1)^T (x - m_1) w + \sum_{x \in D_2} w^T (x - m_2)^T (x - m_2) w} = \frac{w^T (m_1 - m_2)^T (m_1 - m_2) w}{w^T (\sum_{x \in D_1} (x - m_1)^T (x - m_1) + \sum_{x \in D_2} (x - m_2)^T (x - m_2)) w} \end{aligned}$$

令 $S_i = \sum_{x \in D_i} (x - m_i)^T (x - m_i)$ ，則

$$J(w) = \frac{w^T (m_1 - m_2)^T (m_1 - m_2) w}{w^T (S_1 + S_2) w} = \frac{w^T S_B w}{w^T S_A w}$$

我們希望找出 $J(w)$ 最大的 w ，但是假設我們找到一個 w 有著最大的 $J(w)$ ，其常數倍數也都會是解 e.g.

$$J(w) = \frac{w^T S_B w}{w^T S_A w} = \frac{(2w)^T S_B (2w)}{(2w)^T S_A (2w)}$$

故我們設定一限制條件，分母固定為一常數 k ，然後希望最大化分子，我們使用 **Lagrange multiplier**，得

$$L(w) = w^T S_B w - \lambda (w^T S_A w - k)$$

$$\frac{\partial}{\partial w} L(w) = 2S_B w - 2\lambda S_A w = 0$$

$$\Rightarrow S_B w = \lambda S_A w$$

我們可以用特徵向量的方式求解 w ，但前提是 S_A 可逆，其實 S_1, S_2 都是半正定矩陣，只要其任一個 **variance** 不為零就必定可逆，此時我們求解的就是下式的特徵向量

$$S_A^{-1} S_B w = \lambda w$$

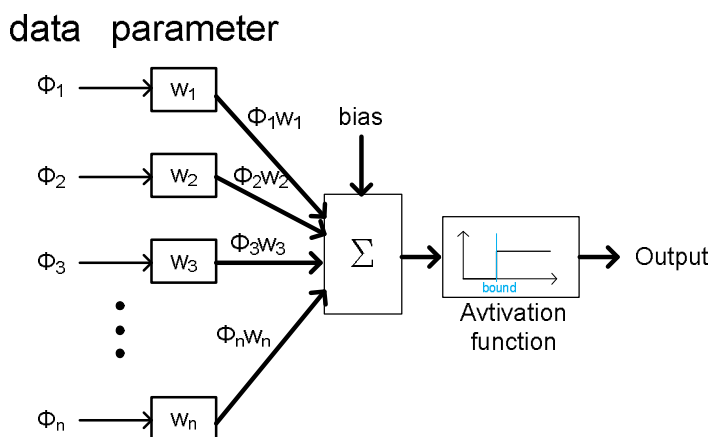
參考資料(寫得非常好且詳細)：<http://www.cmlab.csie.ntu.edu.tw/~cyy/learning/tutorials/LDA.pdf>

perceptron(感知器)

參考資料(我都是看這個)：<http://function1122.blogspot.tw/2010/10/perceptron-learning-algorithm.html>

這裡只是將網站上的內容整理出來，但其實網站已經講的非常的白話且詳細，其實看網站就可以了。但我後面會補上個例子，想要有實際圖形化的感覺可以看我後面的例子。

perception 會根據 test data 來對一輸入 data 進行判斷的工具，其只會提供 Yes/No 兩種輸出結果，下圖是示意圖，將 input data 經過 Xw 後，若值超過一個 bound(通常都是設為 0)，輸出為 Yes(1)，若否，輸出 No(0)



圖片來源(重製)：http://aass.oru.se/~lilien/ml/seminars/2007_02_01b-Janecek-Perceptron.pdf

而因為 activation function 不是一個可微分的函式，故我們在 train data 時沒辦法使用之前使用的 MAP 方式，即將一 data 判斷為正確的分類，求其機率最大的 w ，因為我們會在之中使用微分=0 的方法，這裡我們只能使用 gradient descent 方式。

因為我們還是沒辦法對 activate function 做微分，故我們只在 activation function 之前做 gradient descent，運作的方式簡單來說就是先隨便給定一個參數列(看 basis 有幾維就有幾個參數)，如此可得到一 regression function，每次輸入一筆 data，若預測成功就不會做任何事，如果預測和實際不符，就會利用 Gradient descent 來修正，此方法和牛頓法一樣，會逐漸往最佳的 regression 方向前進，最差也只是不會更動 regression function 而已。

判斷是否預測成功的方法就是代入 regression function，若大於 0 則輸出 Yes，若小於等於 0 就會輸出 No。(這裡就是一個 activate function)

假定我們的參數列為 w ， w_{n+1} 為此次修正後的新參數列， w_n 為之前求出的參數列

Gradient descent 式子為

$$w_{n+1} = w_n + \nabla f(a_n)$$

note:

Gradient descent 原本是想找山谷，所以公式原為 $\mathbf{w}_{n+1} = \mathbf{w}_n - \nabla f(a_n)$ ，但這裡是想找山峰(極大值)，故用+號

$f(a_n)$ 為我們的 regression function，我們只有在預測失敗時才需要修正參數列，故我們將 $f(a_n)$ 表

示為 $f(a_n) = Xwt$

$$\nabla f(a_n) = \frac{\partial}{\partial \mathbf{w}} f(a_n) = Xt$$

故

$$\mathbf{w}_{n+1} = \mathbf{w}_n + Xt$$

當預測失敗時，實際為 Yes 時， $t=1$ ，實際為 No 時， $t=-1$ ，預測成功時則不做修正

note:

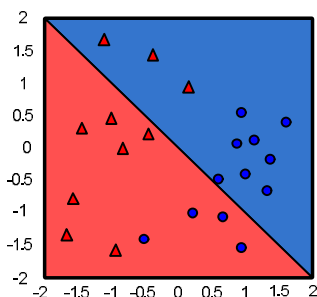
想一下為何 t 要這樣設定，因為若我們猜測錯誤但實際為 Yes 時，代表代入 regression function 的值太小了(<0)，以至於輸出為 No，所以我們需要“往正面”方向移動，故 t 為 1，若猜測錯誤但實際為 No 時，要“往負面”方向移動，故 t 為 -1

舉個例子應該更清楚，我以這個網站舉的例來說明 perceptron 的概念，但我會說明的詳細些
<http://cpmarkchang.logdown.com/posts/189108-machine-learning-perceptron-algorithm>

initial

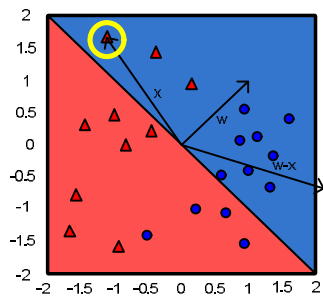
假設空間為二維(有兩個評判標準 x, y)，假設 $w_1=1, w_2=1$ ，regression function 為

$w_1x + w_2y = x + y = 0$ 得到的分類為下圖



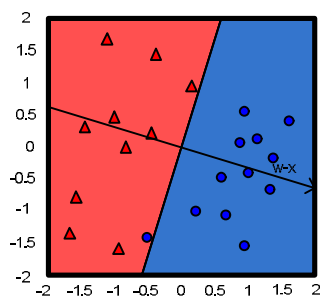
first iteration

隨便拿一預測錯誤的點出來，假設拿到分類錯誤的紅點



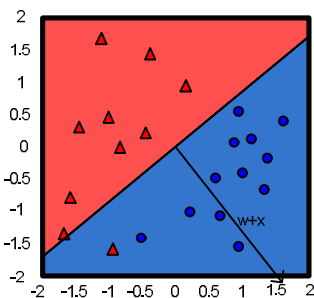
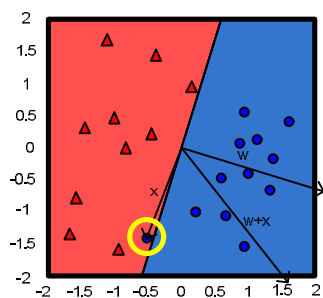
w 是我們的參數列向量，剛好就是 regression function 的法向量， x 是該 test data 的向量，因為預測為 No， w_{n+1} 為 $w_n - X$

修正參數列

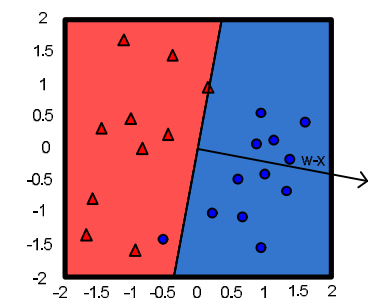
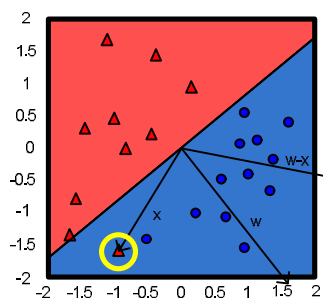


Second iteration

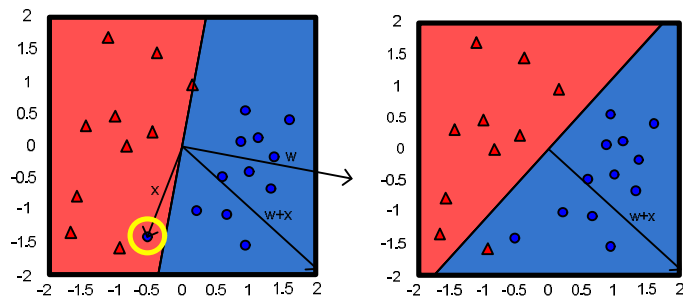
w 是我們的參數列向量，剛好就是 regression function 的法向量， x 是該 test data 的向量，因為預測錯誤且預測為 Yes， w_{n+1} 為 $w_n + X$



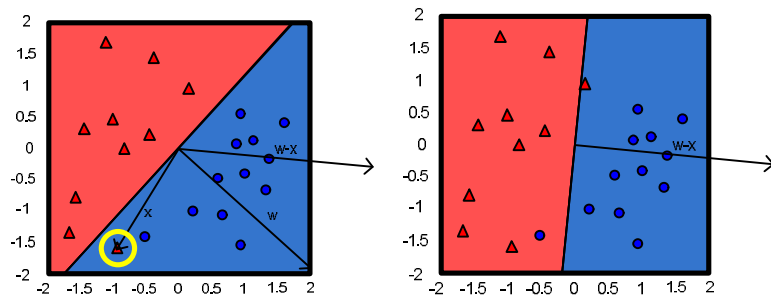
Third iteration



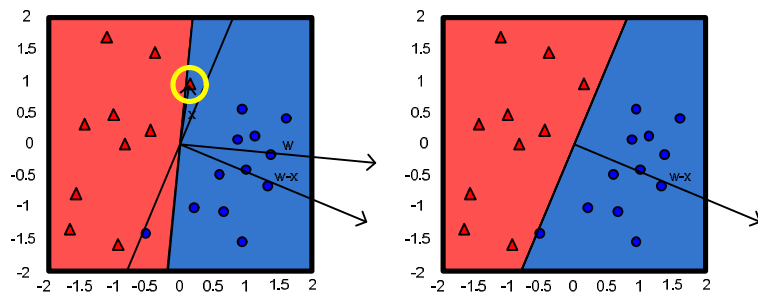
forth iteration



fifth iteration

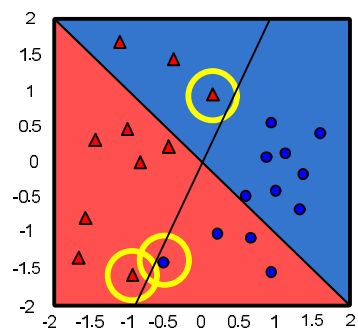


sixth



分類完成！

note(一張一張圖畫完的感想):重點是要將最 critical 的點都做過修正之後，通常就會分類成功了

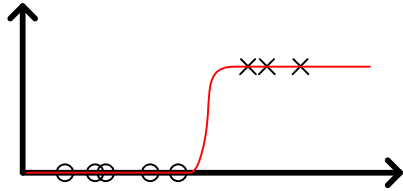


想要有代數感覺的話，可以看這份

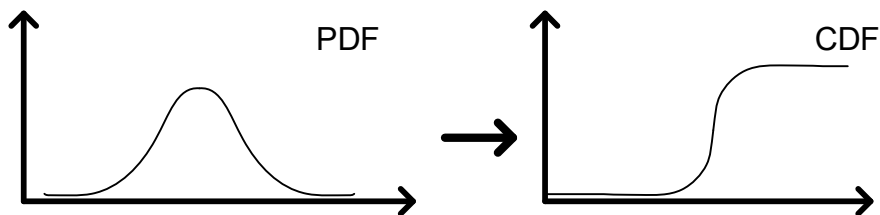
http://aass.oru.se/~lilien/ml/seminars/2007_02_01b-Janecek-Perceptron.pdf

Logistic regression

因為 **activate function** 沒有好的數學性質，我們希望找到近似於 **activate function** 的函數，我們就可以做整塊的 **MAP**，這裡要介紹的就是 **sigmoid function**



1. CDF of Gaussian



Gaussian distribution 的 CDF 形式為 $\frac{1}{2} \left(1 + \operatorname{erf} \left(\frac{x - \mu}{\sigma \sqrt{2}} \right) \right)$

其中

$$\operatorname{erf}(x) = \frac{2}{\sqrt{\pi}} \int_0^x e^{-t^2} dt$$

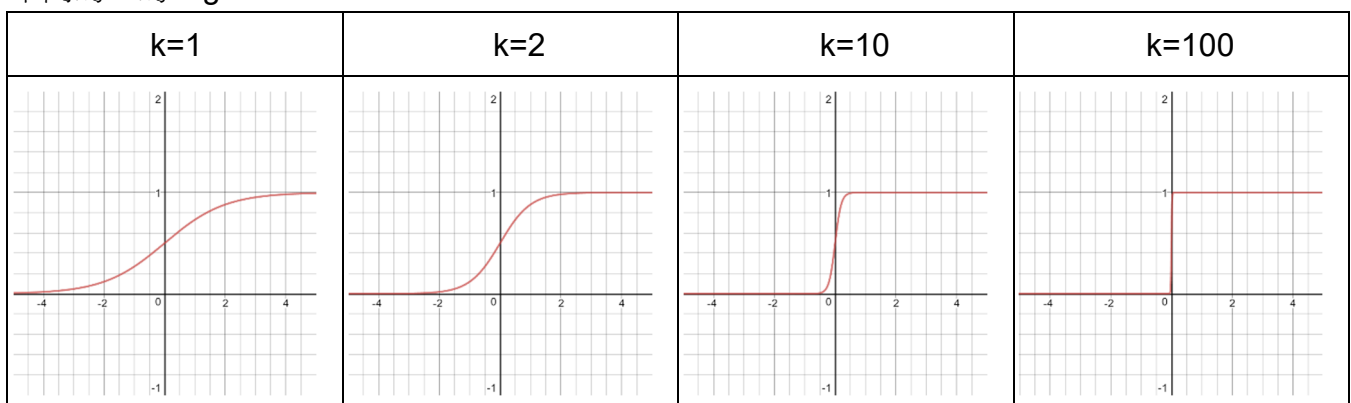
參數為 μ 及 σ ，注意，這裡的 μ 及 σ 都只是用來表示的 **CDF function** 而已，和 **train data** 沒有任何關係。是我們想要結果，我們可以給定我們想要的 μ 及 σ

2. logistic function

函數的外觀和 **CDF** 非常的類似，數學形式為

$$f(x) = \frac{1}{1 + e^{-kx}}$$

不同的 k 的 logistic function



Probability point of view

上課中只有推導要如何找 MLE，MAP 老師說太複雜就沒推導了

參考資料：

<http://web.engr.oregonstate.edu/~xfern/classes/cs534/notes/logistic-regression-note.pdf>

http://web.ntpu.edu.tw/~ccw/statmath/M_logistic.pdf

由於我們目前的分類都是二元的，故我們可以假設其為 Bernoulli 分布

$$y_i \sim \text{Bernoulli}(f(Xw))$$

MLE:

$$\begin{aligned} \arg \max_w P(D|\theta) \\ = \prod_i \left(\frac{1}{1+e^{-x_i w}} \right)^{y_i} \left(\frac{e^{-x_i w}}{1+e^{-x_i w}} \right)^{(1-y_i)} \end{aligned}$$

一樣的，我們先取 log 後，變成累加再微分=0 找極大值

$$J = \sum_{i=1}^n (y_i \log\left(\frac{1}{1+e^{-x_i w}}\right) + (1-y_i) \log\left(\frac{e^{-x_i w}}{1+e^{-x_i w}}\right))$$

w 是一個 vector，形式為 $\begin{bmatrix} w_1 \\ w_2 \\ \dots \\ w_d \end{bmatrix}$ ，我們做微分時一次只看一個 term

for the first term

$$\frac{\partial}{\partial w_j} \log\left(\frac{1}{1+e^{-x_i w}}\right) = \frac{-\partial}{\partial w_j} \log(1+e^{-x_i w}) = \frac{-1}{1+e^{-x_i w}} (-x_{ij}) e^{-x_i w} = \frac{x_{ij} e^{-x_i w}}{1+e^{-x_i w}}$$

x_{ij} 為第 i 個 outcome 中的第 j 個 basis

會有 x_{ij} 出現是因為

$$\frac{\partial}{\partial w_j} x_i w = \begin{bmatrix} 1 & x_i & \dots & x_i^{d-1} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} w_1 \\ w_2 \\ \dots \\ w_d \end{bmatrix} = \frac{\partial}{\partial w_j} (w_1 + w_2 x_i + w_3 x_i^2 + \dots + w_j x_i^{j-1} + \dots) = \frac{\partial}{\partial w_j} w_j x_i^{j-1} = x_i^{j-1}$$

上式的 design matrix 只是隨便舉例，最後剩下的 x_i^{j-1} 是 x_i 中的第 j 項，故記為 x_{ij}

for the second term

$$\begin{aligned}\frac{\partial}{\partial w_j}(1-y_i)\log\left(\frac{e^{-x_i w}}{1+e^{-x_i w}}\right) &= (1-y_i)\frac{\partial}{\partial w_j}(\log e^{-x_i w} + \log\left(\frac{1}{1+e^{-x_i w}}\right)) = (1-y_i)(-x_{ij} + x_{ij}\frac{e^{-x_i w}}{1+e^{-x_i w}}) \\ &= (1-y_i)\frac{-x_{ij}}{1+e^{-x_i w}}\end{aligned}$$

$$\begin{aligned}\frac{\partial J}{\partial w_j} &= \sum_{i=1}^n (y_i \frac{x_{ij} e^{-x_i w}}{1+e^{-x_i w}} - (1-y_i) \frac{x_{ij}}{1+e^{-x_i w}}) \\ &= \sum_{i=1}^n (y_i x_{ij} (1 - \frac{1}{1+e^{-x_i w}}) - (1-y_i) \frac{x_{ij}}{1+e^{-x_i w}}) = \sum_{i=1}^n (y_i x_{ij} - \frac{y_i x_{ij}}{1+e^{-x_i w}} - \frac{x_{ij}}{1+e^{-x_i w}} + \frac{y_i x_{ij}}{1+e^{-x_i w}}) \\ &= \sum_{i=1}^n (y_i x_{ij} - \frac{x_{ij}}{1+e^{-x_i w}}) = \sum_{i=1}^n (x_{ij} (y_i - \frac{1}{1+e^{-x_i w}}))\end{aligned}$$

我們欲求解 $\frac{\partial J}{\partial w_j} = \sum_{i=1}^n (x_{ij} (y_i - \frac{1}{1+e^{-x_i w}})) = 0$ ，如果寫成 matrix form

$$\text{令 } \frac{\partial J}{\partial \mathbf{w}} = \begin{bmatrix} \frac{\partial J}{\partial w_1} \\ \frac{\partial J}{\partial w_2} \\ \dots \\ \frac{\partial J}{\partial w_D} \end{bmatrix}, A = \begin{bmatrix} x_{11} & x_{12} & \dots & x_{1d} \\ x_{21} & x_{22} & \dots & x_{2d} \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ x_{n1} & x_{n2} & \dots & x_{nd} \end{bmatrix}$$

$$\frac{\partial J}{\partial \mathbf{w}} = \begin{bmatrix} \frac{\partial J}{\partial w_1} \\ \frac{\partial J}{\partial w_2} \\ \dots \\ \frac{\partial J}{\partial w_D} \end{bmatrix} = A^T \left(\frac{1}{1+e^{-X_i \mathbf{w}}} - \mathbf{y} \right)$$

note: 找極值取 gradient=0 時，加一負號不影響找極值。

但此方程式是一非線性方程式，故我們無法得到 close form，我們還是只能用 steepest gradient descent 來逼近解。

再講一次 Gradient descent 步驟：

核心公式：

$$\mathbf{w}_{n+1} = \mathbf{w}_n + \nabla_{\mathbf{w}} J$$

$$\mathbf{w}_{n+1} = \mathbf{w}_n + \nabla_{\mathbf{w}} J = \mathbf{w}_n + A^T \left(\frac{1}{1+e^{-x_i \mathbf{w}}} - y_i \right)$$

一直重複直到 \mathbf{w}_{n+1} 逼近至一定值，也就是 $\frac{\partial J}{\partial \mathbf{w}} = A^T \left(\frac{1}{1+e^{-x_i \mathbf{w}}} - y_i \right) = 0$ 那刻

下堂課會提到使用 **Newton's method** 來更快的收斂，會用到 **Hessian matrix**。