

模型选择

一、泛化能力

1. 为了评估机器学习算法的能力，必须给定其性能的衡量指标。
2. 有些情况下，很难决定衡量指标是什么：
 - 如：翻译任务中，应该衡量整个翻译结果的准确率，还是衡量每个单词翻译的准确率？
 - 如：密度估计任务中，很多模型都是隐式地表示概率分布。此时计算样本空间某个点的真实概率是不可行的，因此也就无法判断该点的概率估计的准确率。
3. 通常利用最小化训练误差来训练模型，但是真正关心的是测试误差。因此通过测试误差来评估模型的泛化能力。
 - 训练误差是模型在训练集的平均损失，其大小虽然有意义，但是本质上不重要。
 - 测试误差是模型在测试集上的平均损失，反应了模型对未知测试数据集的预测能力。
4. 模型对未知数据的预测能力称作模型的泛化能力，它是模型最重要的性质。

泛化误差可以反映模型的泛化能力：泛化误差越小，该模型越有效。

5. 假设训练集和测试集共同的、潜在的样本分布称作数据生成分布，记作 $p_{data}(\vec{x}, y)$ 。则泛化误差定义为模型的期望风险，即：

$$R_{exp}(f) = \mathbb{E}[L(y, f(\vec{x}))] = \int_{\mathcal{X} \times \mathcal{Y}} L(y, f(\vec{x})) p_{data}(\vec{x}, y) d\vec{x} dy$$

- 通常泛化误差是不可知的，因为无法获取联合概率分布 $p_{data}(\vec{x}, y)$ 以及无限的采样点。
 - 现实中通常利用测试误差评估模型的泛化能力。由于测试数据集是有限的，因此这种评估结果不完全准确。
6. 统计理论表明：如果训练集和测试集中的样本都是独立同分布产生的，则有 **模型的训练误差的期望等于模型的测试误差的期望**。
 7. 机器学习的“没有免费的午餐定理”表明：在所有可能的数据生成分布上，没有一个机器学习算法总是比其他的要好。
 - 该结论仅在考虑所有可能的数据分布时才成立。
 - 现实中特定任务的数据分布往往满足某类假设，从而可以设计在这类分布上效果更好的学习算法。
 - 这意味着机器学习并不需要寻找一个通用的学习算法，而是寻找一个在关心的数据分布上效果最好的算法。
 8. 正则化是对学习算法做的一个修改，这种修改趋向于降低泛化误差（而不是降低训练误差）。
 - 正则化是机器学习领域的中心问题之一。
 - 没有免费的午餐定理说明了没有最优的学习算法，因此也没有最优的正则化形式。

二、过拟合、欠拟合

1. 当使用机器学习算法时，决定机器学习算法效果的两个因素：降低训练误差、缩小训练误差和测试误差的差距。

这两个因素对应着机器学习中的两个主要挑战：欠拟合和过拟合。
2. 过拟合 `overfitting`：选择的模型包含的参数过多，以至于该模型对于已知数据预测得很好，但是对于未知数据预测的很差，使得训练误差和测试误差之间的差距太大。

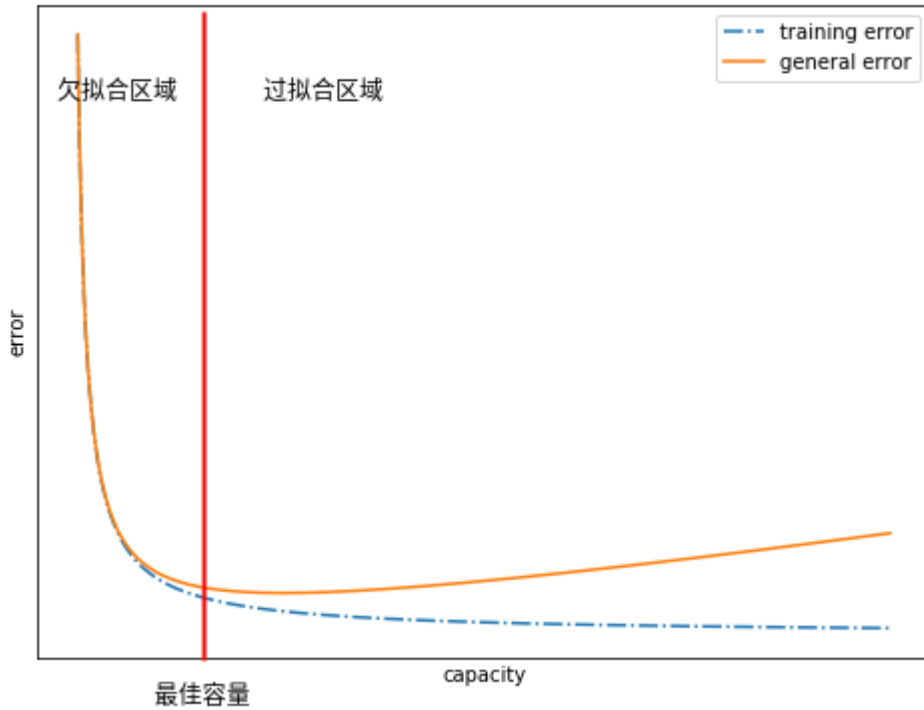
- 过拟合的原因是：将训练样本本身的一些特点当作了所有潜在样本都具有的一般性质，这会造成泛化能力下降。
 - 过拟合无法避免，只能缓解。因为机器学习的问题通常是 **NP** 难甚至更难的，而有效的学习算法必然是在多项式时间内运行完成。如果可以避免过拟合，这就意味着构造性的证明了 **P=NP**。
3. 欠拟合 **underfitting**：选择的模型包含的参数太少，以至于该模型对已知数据都预测的很差，使得训练误差较大。
- 欠拟合的原因一般是学习能力低下造成的。
4. 通过调整模型的容量 **capacity** 可以缓解欠拟合和过拟合。

2.1 模型容量

1. 模型的容量是指其拟合各种函数的能力。
 - 容量低的模型容易发生欠拟合，模型拟合能力太弱。
 - 容量高的模型容易发生过拟合，模型拟合能力太强。
2. 通过选择不同的假设空间可以改变模型的容量。

模型的假设空间指的是：代表模型的函数集合。这也称作模型的表示容量 **representational capacity**。

由于额外的限制因素（比如优化算法的不完善），模型的有效容量 **effective capacity** 一般会小于模型的表示容量。
3. 通常在模型的假设空间中出最佳的函数是非常困难的优化问题，实际应用中只是挑选一个使得训练误差足够低的函数即可。
4. 统计学习理论提供了量化模型容量的方法，其中最出名的是 **VC** 维理论：**训练误差与泛化误差之间差异的上界随着模型容量增长而增长，随着训练样本增多而下降。**
5. 虽然 **VC** 维理论对于机器学习算法有很好的指导作用，但是它在深度学习很难应用。原因有二：
 - 边界太宽泛。
 - 难以确定深度学习的容量。由于深度学习模型的有效容量受限于优化算法，因此确定深度学习模型的容量特别困难。
6. 通常泛化误差是关于模型容量的 **U** 形函数。随着模型容量增大：
 - 训练误差会下降直到逼近其最小值。
 - 泛化误差先减小后增大。
 - 泛化误差与训练误差的差值会增大。



2.2 缓解过拟合

1. 缓解过拟合的策略：

- 正则化。
- 数据集增强：通过人工规则产生虚假数据来创造更多的训练数据。
- 噪声注入：包括输入噪声注入、输出噪声注入、权重噪声注入。将噪声分别注入到输入/输出/权重参数中。
- 早停：当验证集上的误差没有进一步改善时，算法提前终止。

具体内容参考深度学习《正则化》章节。

2. 正则化：基于结构化风险最小化（SRM）策略的实现，其中 $J(f)$ 为正则化项。

在不同的问题中，正则化项可以有不同的形式：

- 回归问题中，损失函数是平方损失，正则化项是参数向量的 L_2 范数。
- 贝叶斯估计中，正则化项对应于模型的先验概率 $\log \frac{1}{g(\theta)}$ 。

2.3 缓解欠拟合

1. 缓解欠拟合的策略：选择一个模型容量更高的模型。

三、偏差方差分解

3.1 点估计

1. 点估计：对参数 θ 的一个预测，记作 $\hat{\theta}$ 。

假设 $\{x_1, x_2, \dots, x_m\}$ 为独立同分布的数据点，该分布由参数 θ 决定。则参数 θ 的点估计为某个函数：

$$\hat{\theta}_m = g(x_1, x_2, \dots, x_m)$$

注意：点估计的定义并不要求 g 返回一个接近真实值 θ 。

2. 根据频率学派的观点：

- 真实参值 θ 是固定的，但是未知的。
- $\hat{\theta}_m$ 是数据点的函数。
- 由于数据是随机采样的，因此 $\hat{\theta}_m$ 是个随机变量。

3.2 偏差

1. 偏差定义为： $bias(\hat{\theta}_m) = \mathbb{E}(\hat{\theta}_m) - \theta$ ，期望作用在所有数据上。

- 如果 $bias(\hat{\theta}_m) = 0$ ，则称估计量 $\hat{\theta}_m$ 是无偏的。
- 如果 $\lim_{m \rightarrow \infty} bias(\hat{\theta}_m) = 0$ ，则称估计量 $\hat{\theta}_m$ 是渐近无偏的。

2. 无偏估计并不一定是最好的估计。

3. 偏差的例子：

- 一组服从均值为 θ 的伯努利分布的独立同分布样本 $\{x_1, x_2, \dots, x_m\}$ ： $\hat{\theta}_m = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m x_i$ 为 θ 的无偏估计。
- 一组服从均值为 μ ，方差为 σ^2 的高斯分布的独立同分布样本 $\{x_1, x_2, \dots, x_m\}$ ：
 - $\hat{\mu}_m = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m x_i$ 为 μ 的无偏估计。
 - $\hat{\sigma}_m^2 = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m (x_i - \hat{\mu}_m)^2$ 为 σ^2 的有偏估计。因为 $\mathbb{E}[\hat{\sigma}_m^2] = \frac{m-1}{m} \sigma^2$
 - $\tilde{\sigma}_m^2 = \frac{1}{m-1} \sum_{i=1}^m (x_i - \hat{\mu}_m)^2$ 为 σ^2 的无偏估计。

3.3 一致性

1. 通常希望当数据集的大小 m 增加时，点估计会收敛到对应参数的真实值。即：

$$\text{plim}_{m \rightarrow \infty} \hat{\theta}_m = \theta$$

plim 表示依概率收敛。即对于任意的 $\epsilon > 0$ ，当 $m \rightarrow \infty$ 时，有： $P(|\hat{\theta}_m - \theta| > \epsilon) \rightarrow 0$

2. 上述条件也称做一致性。它保证了估计偏差会随着样本数量的增加而减少。

3. 渐近无偏不一定意味着一致性。

如：在正态分布产生的数据集中，可以用 $\hat{\mu}_m = x_1$ 作为 μ 的一个估计。

- 它是无偏的，因为 $\mathbb{E}[x_1] = \mu$ ，所以不论观测到多少个数据点，该估计都是无偏的
- 但它不是一致的，因为他不满足 $\text{plim}_{m \rightarrow \infty} \hat{\mu}_m = \mu$

3.4 方差

1. 估计量的方差记作 $Var(\hat{\theta})$ ，标准差记作 $SE(\hat{\theta})$ 。

它们刻画的是：从潜在的数据分布中独立的获取样本集时，估计量的变化程度。

2. 例：一组服从均值为 θ 的伯努利分布的独立同分布样本 $\{x_1, x_2, \dots, x_m\}$

- $\hat{\theta}_m = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m x_i$ 为 θ 的无偏估计。
- $Var(\hat{\theta}_m) = \frac{1}{m} \theta(1 - \theta)$ 。表明估计量的方差随 m 增加而下降。

3. 估计量的方差随着样本数量的增加而下降，这是所有估计量的共性。

4. 例：均值估计 $\hat{\mu}_m = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m x_i$ ，其标准差为：

$$SE(\hat{\mu}_m) = \sqrt{\text{Var} \left[\frac{1}{m} \sum_{i=1}^m x_i \right]} = \frac{\sigma}{\sqrt{m}}$$

其中 σ 是样本 x_i 的真实标准差，但是这个量难以估计。实际上 $\sqrt{\frac{1}{m} \sum_{i=1}^m (x_i - \hat{\mu}_m)^2}$ 和 $\sqrt{\frac{1}{m-1} \sum_{i=1}^m (x_i - \hat{\mu}_m)^2}$ 都不是真实标准差 σ 的无偏估计，这两种方法都倾向于低估真实的标准差。实际应用中， $\sqrt{\frac{1}{m-1} \sum_{i=1}^m (x_i - \hat{\mu}_m)^2}$ 是一种比较合理的近似估计，尤其是当 m 较大的时候。

3.5 偏差方差分解

1. 偏差和方差衡量的是估计量的两个不同误差来源：

- 偏差衡量的是偏离真实值的误差的期望。
- 方差衡量的是由于数据采样的随机性可能导致的估计值的波动。

2. 通常希望的是：

- 估计量的偏差比较小，即：估计量的期望值接近真实值。
- 估计量的方差比较小，即：估计量的波动比较小。

3. 假设：

- 在训练集为 \mathbb{D} 上学习到的模型为 $f_{\mathbb{D}}(\mathbf{x}; \mathbb{D})$ 。

不同的训练集训练得到不同的模型，因此模型与训练集 \mathbb{D} 相关。

- 样本 \mathbf{x} 的观测值为 \tilde{y} ，其真实值为 y 。其中 $\tilde{y} = y + \epsilon$ ， ϵ 为观测误差。

观测误差是由人工标注失误引起的。

- 观察误差的期望为0： $\mathbb{E}_{\mathbb{D}}(\epsilon) = 0$ 。
- 观测误差 ϵ 与真实值 y 是相互独立的。即有： $\mathbb{E}_{\mathbb{D}}(y\epsilon) = \mathbb{E}_{\mathbb{D}}(y) \times \mathbb{E}_{\mathbb{D}}(\epsilon) = 0$ 。
- 样本 \mathbf{x} 的估计量为 $\hat{y}_{\mathbb{D}} = f_{\mathbb{D}}(\mathbf{x}; \mathbb{D})$ 。

定义：

- 损失函数为平方损失函数： $L(\tilde{y}, \hat{y}_{\mathbb{D}}) = (\tilde{y} - \hat{y}_{\mathbb{D}})^2$ 。

○ 对未知样本 \mathbf{x} ：

- 预测偏差为： $bias = (\mathbb{E}_{\mathbb{D}}(\hat{y}_{\mathbb{D}}) - y)^2$ 。它刻画了期望输出与真实值之间的差别。
- 预测方差为： $var = \text{Var}(\hat{y}_{\mathbb{D}}) = \mathbb{E}_{\mathbb{D}}[(\mathbb{E}(\hat{y}_{\mathbb{D}}) - \hat{y}_{\mathbb{D}})^2]$ 。它刻画了模型输出随着训练集 \mathbb{D} 的不同从而导致的波动。
- 噪声方差为： $noise = \text{Var}(\epsilon) = \mathbb{E}_{\mathbb{D}}[(\tilde{y} - y)^2]$ 。它刻画了不同训练集 \mathbb{D} 中的噪音波动。

则未知样本 \mathbf{x} 的泛化误差定义为损失函数的期望： $Loss = \mathbb{E}_{\mathbb{D}}[(\hat{y} - \tilde{y})^2] = \mathbb{E}_{\mathbb{D}}[(f_{\mathbb{D}}(\mathbf{x}; \mathbb{D}) - \tilde{y})^2]$ 。其中使用观测值 \tilde{y} 而不是真实值 y ，是因为观测值已知而真实值未知。

则有：

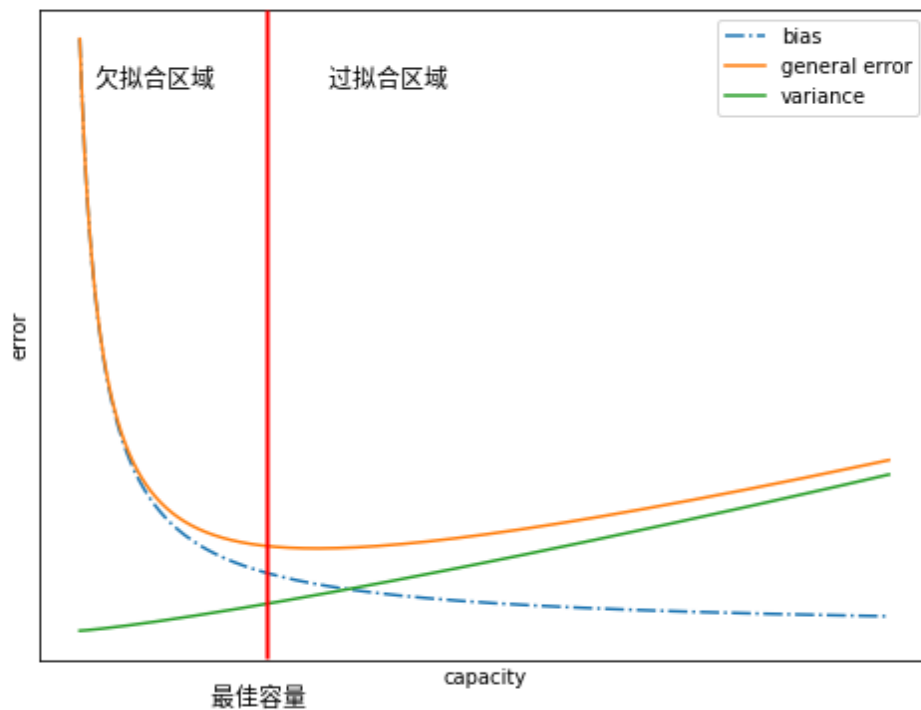
$$\begin{aligned} Loss &= \mathbb{E}_{\mathbb{D}}[(\hat{y}_{\mathbb{D}} - \tilde{y})^2] = \mathbb{E}_{\mathbb{D}}[(\hat{y}_{\mathbb{D}} - \mathbb{E}_{\mathbb{D}}(\hat{y}_{\mathbb{D}}))^2] + (\mathbb{E}_{\mathbb{D}}(\hat{y}_{\mathbb{D}}) - y)^2 + \mathbb{E}_{\mathbb{D}}[(\tilde{y} - y)^2] \\ &= var + bias + var \end{aligned}$$

于是泛化误差可以分解为偏差、方差和噪声之和：

- 偏差 *bias*：度量了学习算法的期望预测与真实结果之间的偏离程度，刻画了学习算法本身的拟合能力。
- 方差 *var*：度量了训练集的变动所导致的学习性能的变化，刻画了数据扰动造成的影响。
- 噪声 *var*：度量了在当前任务上任何学习算法所能达到的期望泛化误差的下界，刻画了学习问题本身的难度。

偏差-方差分解表明：泛化性能是由学习算法的能力、数据的充分性以及学习任务本身的难度共同决定的。

4. 偏差-方差分解中，噪声也可以称作最优误差或者贝叶斯误差。如：在图像识别的问题中，人眼识别的错误率可以视作最优误差。
5. 偏差、方差与模型容量有关。用 `MSE` 衡量泛化误差时，增加容量会增加方差、降低偏差。
 - 偏差降低，是因为随着容量的增大，模型的拟合能力越强：对给定的训练数据，它拟合的越准确。
 - 方差增加，是因为随着容量的增大，模型的随机性越强：对不同的训练集，它学得模型可能差距较大。



6. 一般来说，偏差和方差是由冲突的，这称作偏差-方差窘境 `bias-variance dilemma`。

给定学习任务：

- 在训练不足时模型的拟合能力不够强，训练数据的扰动不足以使模型产生显著变化，此时偏差主导了泛化误差。
- 随着训练程度的加深模型的拟合能力逐渐增强，训练数据发生的扰动逐渐被模型学习到，方差逐渐主导了泛化误差。
- 在训练充分后模型的拟合能力非常强，训练数据发生的轻微扰动都会导致模型发生显著变化。

若训练数据自身的、非全局的特性被模型学到了，则将发生过拟合。

3.6 误差诊断

1. 通常偏差方差反映了模型的过拟合与欠拟合。

- 高偏差对应于模型的欠拟合：模型过于简单，以至于未能很好的学习训练集，从而使得训练误差过高。此时模型预测的方差较小，表示预测较稳定。但是模型预测的偏差会较大，表示预测不准确。
- 高方差对应于模型的过拟合：模型过于复杂，以至于将训练集的细节都学到，将训练集的一些细节当做普遍的规律，从而使得测试集误差与训练集误差相距甚远。此时模型预测的偏差较小，表示预测较准确。但是模型预测的方差较大，表示预测较不稳定。

2. 误差诊断：通过训练误差和测试误差来分析模型是否存在高方差、高偏差。

- 如果训练误差较高：说明模型的方差较大，模型出现了欠拟合。
- 如果训练误差较低，而测试误差较高：说明模型的偏差较大，出现了过拟合。
- 如果训练误差较低，测试误差也较低：说明模型的方差和偏差都适中，是一个比较理想的模型。
- 如果训练误差较高，且测试误差更高：说明模型的方差和偏差都较大。

上述分析的前提是：训练集、测试集的数据来自于同一个分布，且最优误差较小。否则讨论更复杂。

3.7 误差缓解

1. 高方差和高偏差是两种不同的情况。如果算法存在高偏差的问题，则准备更多训练数据其实没什么卵用。

所以首先要清楚：问题是高偏差还是高方差还是二者兼有。

2. 如果模型存在高偏差，则通过以下策略可以缓解：

- 选择一个容量更大、更复杂的模型。
- 使用更先进的最优化算法。该策略通常在神经网络中使用。

3. 如果模型存在高方差，则通过以下策略可以缓解：

- 增加更多的训练数据。它通过更多的训练样本来对模型参数增加约束，会降低模型容量。如果有更多的训练数据，则一定会降低方差。
- 使用正则化。它通过正则化项来对模型参数增加约束，也会降低模型容量。有时候更多的训练数据难以获取，只能使用正则化策略。

4. 通常优先解决高偏差的问题。这是最低标准，要反复尝试，直到训练误差降低到足够小。

然后试图降低方差。

总之就是不断重复尝试，直到找到一个低偏差、低方差的模型。

四、参数估计准则

4.1 最大似然估计

1. 假设数据集 $\mathbf{X} = \{\vec{x}_1, \vec{x}_2, \dots, \vec{x}_m\}$ 中的样本独立同分布地由 $p_{data}(\vec{x})$ 产生，但是该分布是未知的。

$p_{model}(\vec{x}; \theta)$ 是一族由 θ 参数控制的概率分布函数族，希望通过 $p_{model}(\vec{x}; \theta)$ 来估计真实的概率分布函数 $p_{data}(\vec{x})$ ，也就是要估计 θ 参数。

2. 最大似然估计最大化数据集 \mathbf{X} 出现的概率。即：

$$\theta_{ML} = \arg \max_{\theta} p_{model}(\mathbf{X}; \theta) = \arg \max_{\theta} \prod_{i=1}^m p_{model}(\vec{x}_i; \theta)$$

- 由于概率的乘积会因为很多原因不便使用（如容易出现数值下溢出），因此转换为对数的形式：

$$\theta_{ML} = \arg \max_{\theta} \sum_{i=1}^m \log p_{model}(\vec{x}_i; \theta)。$$

- 因为 m 与 θ 无关, 因此它也等价于: $\theta_{ML} = \arg \max_{\theta} \sum_{i=1}^m \frac{1}{m} \log p_{model}(\vec{x}_i; \theta)$ 。
 - 由于数据集的经验分布为: $\hat{p}_{data}(\vec{x}) = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m \delta(\vec{x} - \vec{x}_i)$, 其中 $\delta(\cdot)$ 为狄拉克函数。因此:
 $\theta_{ML} = \arg \max_{\theta} \mathbb{E}_{\vec{x} \sim \hat{p}_{data}} \log p_{model}(\vec{x}; \theta)$ 。
3. 考虑数据集的经验分布 \hat{p}_{data} 和真实分布函数的估计量 p_{model} 之间的差异, KL 散度为:

$$D|_{KL}(\hat{p}_{data} || p_{model}; \theta) = \mathbb{E}_{\vec{x} \sim \hat{p}_{data}} [\log \hat{p}_{data}(\vec{x}) - \log p_{model}(\vec{x}; \theta)]$$

由于 $\log \hat{p}_{data}(\vec{x})$ 与 θ 无关, 因此要使得 $D|_{KL}(\hat{p}_{data} || p_{model}; \theta)$ 最小, 则只需要最小化 $\mathbb{E}_{\vec{x} \sim \hat{p}_{data}} [-\log p_{model}(\vec{x}; \theta)]$ 。也就是最大化 $\mathbb{E}_{\vec{x} \sim \hat{p}_{data}} \log p_{model}(\vec{x}; \theta)$ 。

因此: **最大似然估计就是最小化数据集的经验分布 \hat{p}_{data} 和真实分布函数的估计量 p_{model} 之间的差异。**

4. 最大似然估计可以扩展到估计条件概率。

假设数据集 $\mathbf{X} = \{\vec{x}_1, \vec{x}_2, \dots, \vec{x}_m\}$, 对应的观测值为 $\mathbf{Y} = \{y_1, y_2, \dots, y_m\}$ 。则条件概率的最大似然估计为: $\theta_{ML} = \arg \max_{\theta} p(\mathbf{Y} | \mathbf{X}; \theta)$ 。

如果样本是独立同分布的, 则可以分解成: $\theta_{ML} = \arg \max_{\theta} \sum_{i=1}^m \log p(y_i | \vec{x}_i; \theta)$ 。

5. 最大似然估计有两个很好的性质:

- 在某些条件下, 最大似然估计具有一致性。这意味着当训练样本数量趋向于无穷时, 参数的最大似然估计依概率收敛到参数的真实值。

这些条件为:

- 真实分布 p_{data} 必须位于分布函数族 $p_{model}(\cdot; \theta)$ 中; 否则没有估计量可以表示 p_{data} 。
- 真实分布 p_{data} 必须对应一个 θ 值; 否则从最大似然估计恢复出真实分布 p_{data} 之后, 也不能解出参数 θ 。
- 最大似然估计具有很好的统计效率 **statistic efficiency**。即只需要较少的样本就能达到一个良好的泛化误差。

6. 最大似然估计通常是机器学习中的首选估计准则。

7. 当样本数量太少导致过拟合时, 正则化技巧是最大似然的有偏估计版本。

4.2 贝叶斯估计

4.2.1 贝叶斯估计 vs 最大似然估计

1. 在最大似然估计中, 频率学派的观点是: 真实参数 θ 是未知的固定的值, 而点估计 $\hat{\theta}$ 是随机变量。因为数据是随机生成的, 所以数据集是随机的。

在贝叶斯估计中, 贝叶斯学派认为: 数据集是能够直接观测到的, 因此不是随机的。而真实参数 θ 是未知的、不确定的, 因此 θ 是随机变量。

- 对 θ 的已知的知识表示成先验概率分布 $p(\theta)$: 表示在观测到任何数据之前, 对于参数 θ 的可能取值的一个分布。

在机器学习中, 一般会选取一个相当宽泛的 (熵比较高) 的先验分布, 如均匀分布。

- 假设观测到一组数据 $\mathbf{X} = \{\vec{x}_1, \vec{x}_2, \dots, \vec{x}_m\}$, 根据贝叶斯法则, 有:

$$p(\theta | \mathbf{X}) = \frac{p(\mathbf{X} | \theta)p(\theta)}{p(\mathbf{X})}$$

2. 贝叶斯估计与最大似然估计有两个重要区别:

- 贝叶斯估计预测下, 一个样本的分布为:

$$p(\vec{x}_{m+1} \mid \vec{x}_1, \vec{x}_2, \dots, \vec{x}_m) = \int p(\vec{x}_{m+1} \mid \theta) p(\theta \mid \vec{x}_1, \vec{x}_2, \dots, \vec{x}_m) d\theta$$

而最大似然估计预测下，一个样本的分布为： $p_{model}(\vec{x}; \theta)$

- 贝叶斯估计会使得概率密度函数向着先验概率分布的区域偏移。
3. 当训练数据有限时，贝叶斯估计通常比最大似然估计泛化性能更好。
- 当训练样本数量很大时，贝叶斯估计往往比最大似然估计计算代价较高。

4.2.2 最大后验估计

1. 有时候希望获取参数 θ 的一个可能的值，而不仅仅是它的一个分布。此时可以通过最大后验估计 **MAP** 选择后验概率最大的点：

$$\theta_{MAP} = \arg \max_{\theta} p(\theta \mid \mathbf{X}) = \arg \max_{\theta} [\log p(\mathbf{X} \mid \theta) + \log p(\theta)]$$

2. 最大后验估计具有最大似然估计没有的优势：拥有先验知识带来的信息。该信息有助于减少估计量的方差，但是增加了偏差。
3. 一些正则化方法可以被解释为最大后验估计，正则化项就是对应于 $\log p(\theta)$ 。
- 并非所有的正则化方法都对应为某个最大后验估计。
- 如：有些正则化项依赖于数据，则显然不是一个先验概率分布
4. 最大后验估计估计 **MAP** 提供了一个直观的方法去设计复杂的、可解释的正则化项。
- 更复杂的正则化项可以通过先验分布为混合高斯分布得到（而不仅仅是一个单独的高斯分布）。

五、泛化能力评估

1. 模型泛化能力的评估：用测试集对模型进行评估。通常有下列方法：
- 留出法 **hold-out**。
 - **K** 折交叉验证法 **cross validation**。
 - 留一法 **Leave-One-Out: LOO**。
 - 自助法 **bootstrapping**。

5.1 留出法

1. 留出法：直接将数据切分为三个互斥的部分（也可以切分成两部分，此时训练集也是验证集），然后在训练集上训练模型，在验证集上选择模型，最后用测试集上的误差作为泛化误差的估计。
2. 数据集的划分要尽可能保持数据分布的一致性，避免因数据划分过程引入额外的偏差而对最终结果产生影响。若训练集、验证集、测试集中类别比例差别很大，则误差估计将由于训练/验证/测试数据分布的差异而产生偏差。
- 如：在分类任务中至少要保持样本的类别比例相似。如果从采样的角度来看数据集中的划分过程，则保留类别比例的采样方式称作“分层采样”(**stratified sampling**)。
3. 即使进行了分层采样，仍然存在多种划分方式对数据集进行划分（比如排序后再划分、随机划分...）。这些不同的划分将导致不同的训练集/验证集/测试集。因此单次留出法得出的估计结果往往不够稳定可靠。
- 在使用留出法时，往往采用若干次随机划分、重复进行实验评估后，取平均值作为留出法的评估结果。

5.2 K 折交叉验证

1. K 折交叉验证法：数据随机划分为 K 个互不相交且大小相同的子集，利用 $K-1$ 个子集数据训练模型，利用余下的一个子集测试模型（一共有 $C_K^{K-1} = K$ 种组合）。

对 K 种组合依次重复进行，获取测试误差的均值，将这个均值作为泛化误差的估计。

2. 与留出法相似，将数据集划分为 K 个子集同样存在多种划分方式。为了减少因为样本划分不同而引入的差别， K 折交叉验证通常需要随机使用不同划分重复 p 次，这 p 次 K 折交叉验证的测试误差均值作为最终的泛化误差的估计。

5.3 留一法

1. 留一法：假设数据集中存在 N 个样本，令 $K = N$ 则得到了 K 折交叉验证的一个特例。

2. 优点：由于训练集与初始数据集相比仅仅少一个样本，因此留一法的训练数据最多。

缺点：在数据集比较大时，训练 N 个模型的计算量太大。

5.4 自助法

1. 在留出法和 K 折交叉验证法中，由于保留了一部分样本用于测试，因此实际训练模型使用的训练集比初始数据集小，这必然会引入一些因为训练样本规模不同而导致的估计偏差。

留一法受训练样本规模变化的影响较小，但是计算复杂度太高。

自助法是一个以自助采样法(`bootstrap sampling`)为基础的比较好的解决方案。

2. 自助采样法：给定包含 N 个样本的数据集 \mathbb{D} ，对它进行采样产生数据集 \mathbb{D}' ：

- 每次随机从 \mathbb{D} 中挑选一个样本，将其拷贝放入 \mathbb{D}' 中，然后再将该样本放回初始数据集 \mathbb{D} 中（该样本下次采样时仍然可以被采到）。
- 重复这个过程 N 次，就得到了包含 N 个样本的数据集 \mathbb{D}' 。

3. 显然， \mathbb{D} 中有些样本会在 \mathbb{D}' 中多次出现了； \mathbb{D} 中有些样本在 \mathbb{D}' 中从不出现。 \mathbb{D} 中某个样本始终不被采到的概率为 $(1 - \frac{1}{N})^N$ 。

根据极限 $\lim_{N \rightarrow \infty} (1 - \frac{1}{N})^N = \frac{1}{e} \simeq 0.368$ ，即通过自助采样，初始数据集 \mathbb{D} 中约有 36.8% 的样本未出现在采样数据集 \mathbb{D}' 中。

将 \mathbb{D}' 用作训练集， $\mathbb{D} - \mathbb{D}'$ 用作测试集，这样的测试结果称作包外估计 `out-of-bag estimate`。

4. 自助法在数据集较小时很有用。

- 优点：能从初始数据集中产生多个不同的训练集，这对集成学习等方法而言有很大好处。
- 缺点：产生的数据集改变了初始数据集的分布，这会引入估计偏差。因此在初始数据量足够时，留出法和折交叉验证法更常用。

六、训练集、验证集、测试集

6.1 训练集

1. 训练集用于训练模型。理论上训练集越大越好。

6.2 验证集

1. 大多数机器学习算法具有超参数，超参数的值无法通过学习算法拟合出来（比如正则化项的系数、控制模型容量的参数）。
2. 为了解决这个问题，可以引入验证集。将训练数据分成两个不相交的子集：训练集用于学习模型，验证集用于更新超参数。

- 通常要求验证集足够大。如果验证集很小，那么模型的超参数可能就记住了一个小验证集里的样本，模型将对验证集严重过拟合。
- 验证集通常会低估泛化误差。因此当超参数优化完成后，需要通过测试集来估计泛化误差。

6.3 测试集

- 测试集用于评估模型的泛化误差。理论上测试集越大，则模型的泛化误差评估的越准确。
- 测试集中的样本一定不能是训练样本。如果将训练样本放入测试集中，则会低估泛化误差。
- 测试集 vs 验证集：
 - 测试集通常用于对模型的预测能力进行评估，它提供了模型预测能力的无偏估计。
如果你不需要对模型预测能力的无偏估计，则不需要测试集。
 - 验证集用于超参数的选择，它无法提供模型预测能力的有偏估计。
因为模型依赖于超参数，而超参数依赖于验证集。因此验证集参与了模型的构建，这意味着模型已经考虑了验证集的信息。

6.4 拆分

- 对于小批量数据，数据的拆分的常见比例为：
 - 如果未设置验证集，则将数据三七分：70% 的数据用作训练集、30% 的数据用作测试集。
 - 如果设置验证集，则将数据划分为：60% 的数据用作训练集、20% 的数据用过验证集、20% 的数据用作测试集。
- 对于大批量数据，验证集和测试集占总数据的比例会更小。
 - 对于百万级别的数据，其中1万条作为验证集、1万条作为测试集即可。
 - 验证集的目的就是验证不同的超参数；测试集的目的就是比较不同的模型。
 - 一方面它们要足够大，才足够评估超参数、模型。
 - 另一方面，如果它们太大，则会浪费数据（验证集和训练集的数据无法用于训练）。
- 在 k 折交叉验证中：先将所有数据拆分成 k 份，然后其中 1 份作为测试集，其他 $k-1$ 份作为训练集。
 - 这里并没有验证集来做超参数的选择。所有测试集的测试误差的均值作为模型的预测能力的一个估计。
 - 使用 k 折交叉的原因是：样本集太小。如果选择一部分数据来训练，则有两个问题：
 - 训练数据的分布可能与真实的分布有偏离。 k 折交叉让所有的数据参与训练，会使得这种偏离得到一定程度的修正。
 - 训练数据太少，容易陷入过拟合。 k 折交叉让所有数据参与训练，会一定程度上缓解过拟合。

6.5 分布不匹配

- 深度学习时代，经常会发生：训练集和验证集、测试集的数据分布不同。
如：训练集的数据可能是从网上下载的高清图片，测试集的数据可能是用户上传的、低像素的手机照片。
 - 必须保证验证集、测试集的分布一致，它们都要很好的代表你的真实应用场景中的数据分布。
 - 训练数据可以与真实应用场景中的数据分布不一致，因为最终关心的是在模型真实应用场景中的表现。
- 如果发生了数据不匹配问题，则可以想办法让训练集的分布更接近验证集。
 - 一种做法是：收集更多的、分布接近验证集的数据作为训练集合。
 - 另一种做法是：人工合成训练数据，使得它更接近验证集。

该策略有一个潜在问题：你可能只是模拟了全部数据空间中的一小部分。导致你的模型对这一小部分过拟合。

3. 当训练集和验证集、测试集的数据分布不同时，有以下经验原则：

- 确保验证集和测试集的数据来自同一分布。

因为需要使用验证集来优化超参数，而优化的最终目标是希望模型在测试集上表现更好。

- 确保验证集和测试集能够反映未来得到的数据，或者最关注的的数据。
- 确保数据被随机分配到验证集和测试集上。

4. 当训练集和验证集、测试集的数据分布不同时，分析偏差和方差的方式有所不同。

- 如果训练集和验证集的分布一致，那么当训练误差和验证误差相差较大时，我们认为存在很大的方差问题。
- 如果训练集和验证集的分布不一致，那么当训练误差和验证误差相差较大时，有两种原因：
 - 第一个原因：模型只见过训练集数据，没有见过验证集的数据导致的，是数据不匹配的问题。
 - 第二个原因：模型本来就存在较大的方差。

为了弄清楚原因，需要将训练集再随机划分为：训练-训练集、训练-验证集。这时候，训练-训练集、训练-验证集是同一分布的。

- 模型在训练-训练集和训练-验证集上的误差的差距代表了模型的方差。
- 模型在训练-验证集和验证集上的误差的差距代表了数据不匹配问题的程度。

七、性能度量

1. 给定训练集 $\mathbb{D} = \{(\vec{x}_1, \tilde{y}_1), (\vec{x}_2, \tilde{y}_2), \dots, (\vec{x}_N, \tilde{y}_N)\}$ ，测试集合 $\mathbb{T} = \{(\vec{x}'_1, \tilde{y}'_1), (\vec{x}'_2, \tilde{y}'_2), \dots, (\vec{x}'_{N'}, \tilde{y}'_{N'})\}$ 。

对于样本 \vec{x} ，假设其真实标记为 \tilde{y} ，模型预测输出为 \hat{y} 。

2. 理论上性能度量都是在测试集上进行。

- 如果是在训练集上度量，则相应的指标为：训练准确率、训练错误率、训练 auc ...
- 如果是在验证集上度量，则相应的指标为：验证准确率、验证错误率、验证 auc ...

7.1 分类问题性能度量

7.1.1 准确率、错误率

1. 测试准确率：测试数据集上的准确率（其中 I 为示性函数）：

$$r_{test} = \frac{1}{N'} \sum_{i=1}^{N'} I(\tilde{y}'_i = \hat{y}'_i)$$

准确率衡量的是有多少比例的样本被正确判别。

2. 测试错误率：测试数据集上的错误率：

$$e_{test} = \frac{1}{N'} \sum_{i=1}^{N'} I(\tilde{y}'_i \neq \hat{y}'_i)$$

错误率衡量的是有多少比例的样本被判别错误，它也是损失函数为 0-1 损失时的测试误差。

7.1.2 查准率、查全率

1. 对于二分类问题，通常将关注的类作为正类，其他类作为负类。令：

- TP：分类器将正类预测为正类的数量(True Positive)。即：真 正类 的数量。
- FN：分类器将正类预测为负类的数量(False Negative)。即：假 负类 的数量。
- FP：分类器将负类预测为正类的数量(False Positive)。即：假 正类 的数量。
- TN：分类器将负类预测为负类的数量(True Negative)。即：真 负类 的数量。

分类结果的混淆矩阵(confusion matrix)定义为：

	预测：正类	预测：反类
真实：正类	TP	FN
真实：反类	FP	TN

2. 查准率(precision)： $P = \frac{TP}{TP+FP}$ 。

它刻画了所有预测为正类的结果中，真正的正类的比例。

3. 查全率(recall)： $R = \frac{TP}{TP+FN}$ 。

它刻画了真正的正类中，被分类器找出来的比例。

4. 不同的问题中，有的侧重查准率，有的侧重查全率。

- 对于推荐系统，更侧重于查准率。即推荐的结果中，用户真正感兴趣的比例。因为给用户展示的窗口有限，必须尽可能的给用户展示他真实感兴趣的结果。
- 对于医学诊断系统，更侧重与查全率。即疾病被发现的比例。因为疾病如果被漏诊，则很可能导致病情恶化。

5. 查准率和查全率是一对矛盾的度量。一般来说查准率高时查全率往往偏低，而查全率高时查准率往往偏低。

- 如果希望将所有的正例都找出来（查全率高），最简单的就是将所有的样本都视为正类，此时有 $FN=0$ 。此时查准率就偏低（准确性降低）。
- 如果希望查准率高，则可以只挑选有把握的正例。最简单的就是挑选最有把握的那一个样本。此时有 $FP=0$ 。此时查全率就偏低（只挑出了一个正例）。

7.1.3 P-R 曲线

1. 对二类分类问题，可以根据分类器的预测结果对样本进行排序：排在最前面的是分类器认为“最可能”是正类的样本，排在最后面的是分类器认为“最不可能”是正类的样本。

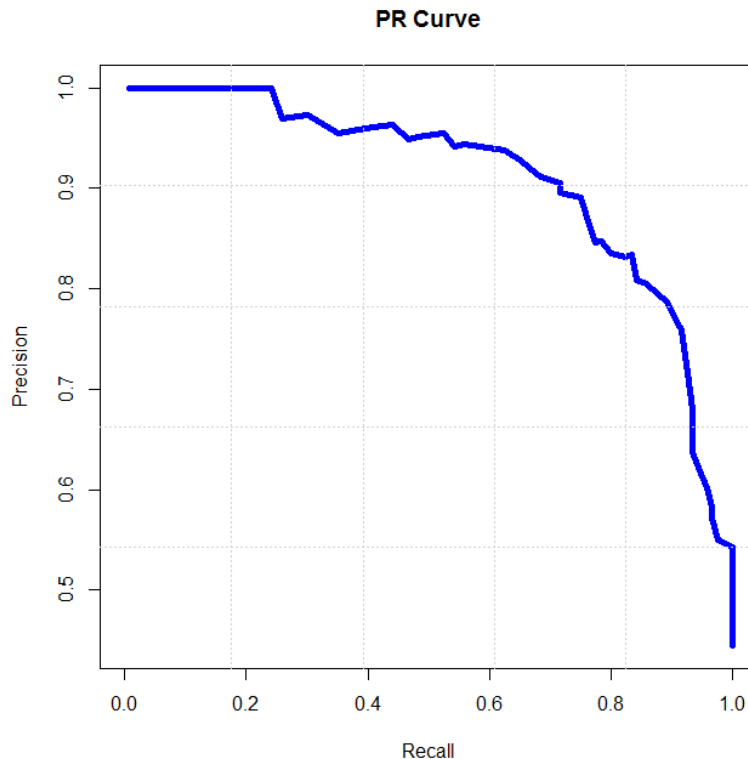
假设排序后的样本集合为 $(\vec{x}_1, \tilde{y}_1), (\vec{x}_2, \tilde{y}_2), \dots, (\vec{x}_N, \tilde{y}_N)$ ，预测为正类的概率依次为 (p_1, p_2, \dots, p_N) 。

在第 i 轮，将 p_i 作为分类阈值来。即：

$$\hat{y}_j = \begin{cases} 1, & \text{if } p_j \geq p_i \\ 0, & \text{else} \end{cases}, \quad j = 1, 2, \dots, N$$

此时计算得到的查准率记做 P_i ，查全率记做 R_i 。

以查准率为纵轴、查全率为横轴作图，就得到查准率-查全率曲线，简称 P-R 曲线。该曲线由点 $\{(R_1, P_1), (R_2, P_2), \dots, (R_N, P_N)\}$ 组成。



2. P-R 曲线从左上角 $(0,1)$ 到右下角 $(1,0)$ 。

- 开始时第一个样本（最可能为正例的）预测为正例，其它样本都预测为负类。此时：

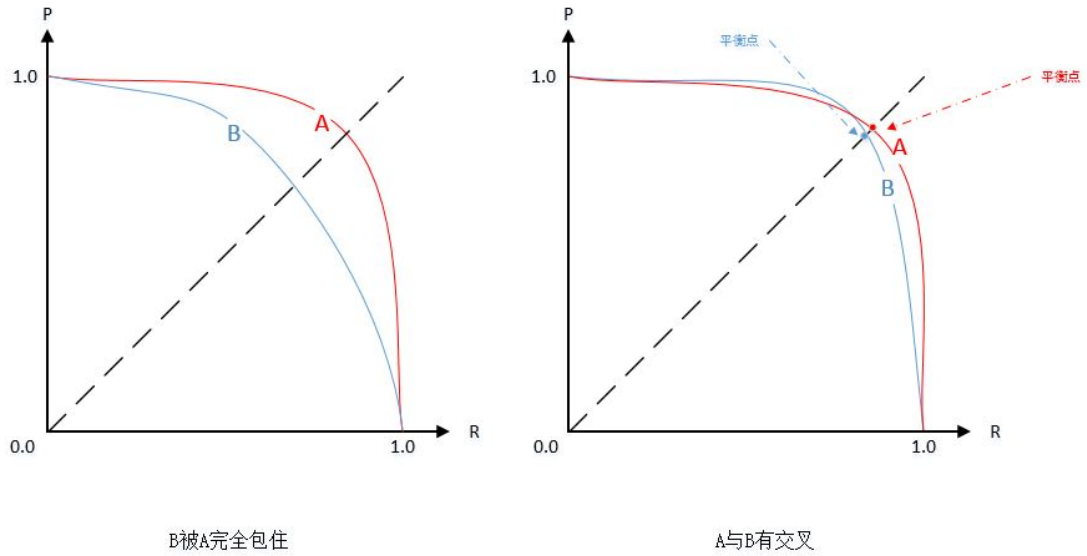
- 查准率很高，几乎为1。
- 查全率很低，几乎为0，大量的正例没有找到。

- 结束时所有的样本都预测为正类。此时：

- 查全率很高，正例全部找到了，查全率为1。
- 查准率很低，大量的负类被预测为正类。

3. P-R 曲线直观显示出分类器在样本总体上的查全率、查准率。因此可以通过两个分类器在同一个测试集上的 P-R 曲线来比较它们的预测能力：

- 如果分类器 B 的 P-R 曲线被分类器 A 的曲线完全包住，则可断言：A 的性能好于 B。
- 如果分类器 A 的 P-R 曲线与分类器 B 的曲线发生了交叉，则难以一般性的断言两者的优劣，只能在具体的查准率和查全率下进行比较。
 - 此时一个合理的判定依据是比较 P-R 曲线下面积大小，但这个值通常不容易计算。
 - 可以考察平衡点。平衡点 Break-Even Point: BEP 是 P-R 曲线上查准率等于查全率的点，可以判定：平衡点较远的 P-R 曲线较好。



7.1.4 ROC曲线

1. 定义真正例率(True Positive Rate)为: $TPR = \frac{TP}{TP+FN}$ 。

它刻画了真正的正类中, 被分类器找出来的比例。它也就等于正类的查全率。

2. 定义假正例率(False Positive Rate)为: $FPR = \frac{FP}{TN+FP}$ 。

它刻画了模型将真实的负样本预测为正类的概率。它就等于 1 减去负类的查全率。

3. 对二类分类问题, 可以根据分类器的预测结果对样本进行排序: 排在最前面的是分类器认为“最可能”是正类的样本, 排在最后面的是分类器认为“最不可能”是正类的样本。

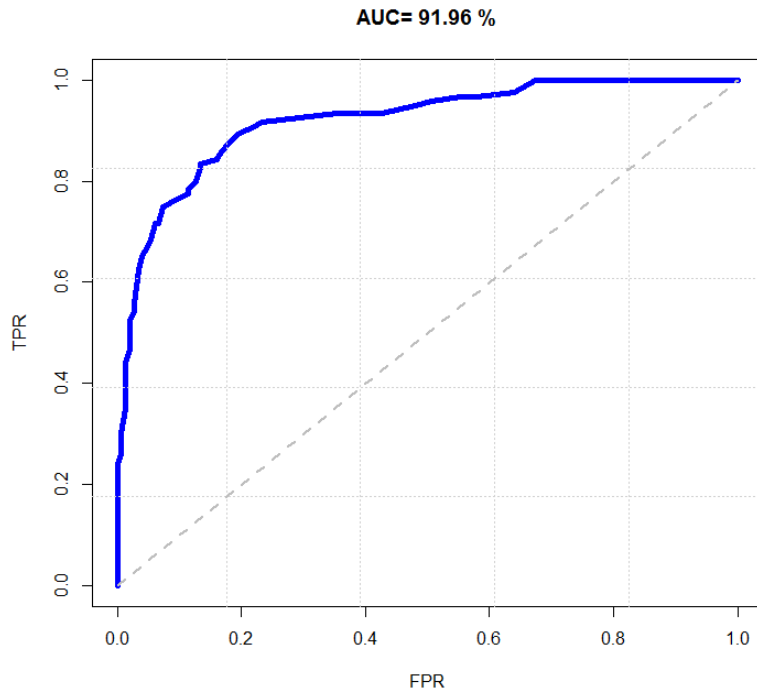
假设排序后的样本集合为 $(\vec{x}_1, \tilde{y}_1), (\vec{x}_2, \tilde{y}_2), \dots, (\vec{x}_N, \tilde{y}_N)$, 预测为正类的概率依次为 (p_1, p_2, \dots, p_N) 。

在第 i 轮, 将 p_i 作为分类阈值来。即:

$$\hat{y}_j = \begin{cases} 1, & \text{if } p_j \geq p_i \\ 0, & \text{else} \end{cases}, \quad j = 1, 2, \dots, N$$

此时计算得到的真正例率记做 TPR_i , 假正例率记做 FPR_i 。

以真正例率为纵轴、假正例率为横轴作图, 就得到 ROC 曲线。该曲线由点 $\{(TPR_1, FPR_1), (TPR_2, FPR_2), \dots, (TPR_N, FPR_N)\}$ 组成。



4. ROC 曲线从左下角 $(0,0)$ 到右上角 $(1,1)$ 。

- 开始时第一个样本（最可能为正例的）预测为正例，其它样本都预测为负类。此时：
 - 真正例率很低，几乎为0，因为大量的正例未预测到。
 - 假正例率很低，几乎为0，因为此时预测为正类的样本很少，所以几乎没有错认的正例。
- 结束时所有的样本都预测为正类。此时：
 - 真正例率很高，几乎为1，因为所有样本都预测为正类。
 - 假正例率很高，几乎为1，因为所有的负样本都被错认为正类。

5. 在 ROC 曲线中：

- 对角线对应于随机猜想模型。
- 点 $(0,1)$ 对应于理想模型：没有预测错误，FPR 恒等于0，TPR 恒等于1。
- 通常 ROC 曲线越靠近点 $(0,1)$ 越好。

6. 可以通过两个分类器在同一个测试集上的 ROC 曲线来比较它们的预测能力：

- 如果分类器 A 的 ROC 曲线被分类器 B 的曲线完全包住，则可断言：B 的性能好于 A。
- 如果分类器 A 的 ROC 曲线与分类器 B 的曲线发生了交叉，则难以一般性的断言两者的优劣。
此时一个合理的判定依据是比较 ROC 曲线下面积大小，这个面积称作 AUC:Area Under ROC Curve。

7. P-R 曲线和 ROC 曲线刻画的都是阈值的选择对于分类度量指标的影响。

通常一个分类器对样本预测的结果是一个概率结果，比如正类概率 0.7。但是样本是不是正类还需要与阈值比较。

这个阈值会影响了分类器的分类结果，比如：是阈值 0.5 还是阈值 0.9。

- 如果更重视查准率，则将阈值提升，比如为 0.9。
- 如果更看重查全率，则将阈值下降，比如为 0.5。

8. P-R 曲线和 ROC 曲线上的每一个点都对应了一个阈值的选择，该点就是在该阈值下的（查准率，查全率）/（真正例率，假正例率）。

沿着横轴的方向对应着阈值的下降。

7.1.5 F1 值

1. F_1 为查准率与查全率的调和均值: $\frac{2}{F_1} = \frac{1}{P} + \frac{1}{R}$ 。
2. F_1 更一般的形式: $\frac{1}{F_\beta} = \frac{1}{(1+\beta^2) \times P} + \frac{\beta^2}{(1+\beta^2) \times R}$, 其中 $\beta^2 > 0$ 度量了查全率对查准率的相对重要性。

7.1.6 代价矩阵

1. 实际应用过程中, 不同类型的错误所造成的后果可能有所不同。如: 将健康人诊断为患者, 与将患者诊断为健康人, 其代价就不同。

为权衡不同类型错误所造成的不同损失, 可以为错误赋予非均等代价 (unequal cost)。

对于二类分类问题, 可以设定一个“代价矩阵”(cost matrix), 其中 $cost_{ij}$ 表示将第 i 类样本预测为第 j 类样本的代价。通常 $cost_{ii} = 0$ 表示预测正确时的代价为0。

	预测: 第0类	预测: 第1类
真实: 第0类	0	$cost_{01}$
真实: 第1类	$cost_{10}$	0

前面讨论的性能度量都隐式的假设均等代价, 即 $cost_{01} = cost_{10}$

2. 在非均等代价下, 希望找到的不再是简单地最小化错误率的模型, 而是希望找到最小化总体代价 (total cost) 的模型。
3. 在非均等代价下, ROC 曲线不能直接反映出分类器的期望总体代价, 此时需要使用代价曲线 (cost curve)。
 - 代价曲线的横轴就是正例概率代价。

$$P_{+cost} = \frac{p \times cost_{01}}{p \times cost_{01} + (1 - p) \times cost_{10}}$$

其中 p 为正例 (第0类) 的概率。

- 代价曲线的纵轴为:

$$cost_{norm} = \frac{FNR \times p \times cost_{01} + FPR \times (1 - p) \times cost_{10}}{p \times cost_{01} + (1 - p) \times cost_{10}}$$

其中:

- FPR 为假正例率 $FPR = \frac{FP}{TN+FP}$ 。
它刻画了模型将真实的负样本预测为正类的概率。
- FNR 为假负例率 $FNR = 1 - TPR = \frac{FN}{TP+FN}$ 。
它刻画了模型将真实的正样本预测为负类的概率。

7.1.7 宏查准率/查全率、微查准率/查全率

1. 有时候可能得到了多个二分类混淆矩阵。如: 在多个数据集上进行训练/测试。
此时希望在多个二分类混淆矩阵上综合考察查准率和查全率。
2. 假设有 m 个二分类混淆矩阵, 有两种方法来综合考察:

- 宏查准确率、宏查全率：先在各个混淆矩阵上分别计算查准率和查全率，记作 $(P_1, R_1), (P_2, R_2), \dots, (P_m, R_m)$ ；然后计算平均值。

这样得到的是宏查准确率 (macro-P)，宏查全率 (macro-F)，宏 F1 (macro-F1)：

$$\text{macro-P} = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m P_i, \text{macro-R} = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m R_i, \frac{2}{\text{macro-F}_1} = \frac{1}{\text{macro-P}} + \frac{1}{\text{macro-R}}。$$

- 微查准确率、微查全率：先将个混淆矩阵对应元素进行平均，得到 TP, FP, TN, FN 的平均值，记作 $\overline{TP}, \overline{FP}, \overline{TN}, \overline{FN}$ ；再基于这些平均值计算微查准确率 (micro-P)，微查全率 (micro-F)，微 F1 (micro-F1)：

$$\text{micro-P} = \frac{\overline{TP}}{\overline{TP} + \overline{FP}}, \text{micro-R} = \frac{\overline{TP}}{\overline{TP} + \overline{FN}}, \frac{2}{\text{micro-F}_1} = \frac{1}{\text{micro-P}} + \frac{1}{\text{micro-R}}。$$

7.2 回归问题性能度量

- 均方误差 (mean square error:MSE) : $MSE = \frac{1}{N'} \sum_{i=1}^{N'} (\tilde{y}'_i - \hat{y}'_i)^2$ 。
- 均方根误差 (root mean squared error:RMSE) : $RMSE = \sqrt{\frac{1}{N'} \sum_{i=1}^{N'} (\tilde{y}'_i - \hat{y}'_i)^2}$ 。
- 均方根对数误差 (root mean squared logarithmic error:RMSLE) :

$$RMLSE = \sqrt{\frac{1}{N'} \sum_{i=1}^{N'} [\log(\tilde{y}'_i) - \log(\hat{y}'_i)]^2}。$$

为使得 \log 有意义，也可以使用： $RMSLE = \sqrt{\frac{1}{N'} \sum_{i=1}^{N'} [\log(\tilde{y}'_i + 1) - \log(\hat{y}'_i + 1)]^2}$ 。

优势：

- 当真实值的分布范围比较广时（如：年收入可以从 0 到非常大的数），如果使用 MAE、MSE、RMSE 等误差，这将使得模型更关注于那些真实标签值较大的样本。
而 RMSLE 关注的是预测误差的比例，使得真实标签值较小的样本也同等重要。
- 当数据中存在标签较大的异常值时，RMSLE 能够降低这些异常值的影响。

- 平均绝对误差 (mean absolute error:MAE) : $MAE = \frac{1}{N'} \sum_{i=1}^{N'} |\tilde{y}'_i - \hat{y}'_i|$ 。

七、超参数调节

- 大多数学习算法都有些超参数需要设定。超参数配置不同，学得模型性能往往有显著差别，这就是参数调节 (parameter tuning)：对每种超参数配置都训练出模型，然后把对应最好模型的超参数作为结果。
- 由于很多超参数是在实数范围内取值，因此现实中常用做法是对每个超参数选定一个范围和变化步长。如在 $[0, 1)$ 范围内以 0.2 为步长。
这样选出的超参数可能不是最佳的，但是这是在计算开销和性能之间取折中的结果。
- 当模型选择完成后，学习算法和超参数配置已经选定，此时应该用数据集 \mathbb{D} 重新训练模型。
这个模型在训练过程中使用了 N 个样本，这才是最终提交的模型。

7.1 搜索策略

- 超参数搜索有三种常见的策略：
 - 手动搜索：手动选择超参数。
 - 网格搜索：当超参数的数据相对较少时，这个方法很实用。
 - 随机搜索：通常推荐这种方式。

7.1.1 手动搜索

1. 手动选择超参数需要了解超参数做了些什么，以及机器学习模型如何才能取得良好的泛化。
2. 手动搜索超参数的任务是：在给定运行时间和内存预算范围的条件下，最小化泛化误差。
3. 手动调整超参数时不要忘记最终目标：提升测试集性能。
 - 加入正则化只是实现这个目标的一种方法。
 - 如果训练误差很低，也可以通过收集更多的训练数据来减少泛化误差。
如果训练误差太大，则收集更多的训练数据就没有意义。
 - 实践中的一种暴力方法是：不断提高模型容量和训练集的大小。
这种方法增加了计算代价，只有在拥有充足的计算资源时才可行

7.1.2 网格搜索

1. 网格搜索的做法是：
 - 对于每个超参数，选择一个较小的有限值集合去搜索。
 - 然后这些超参数笛卡尔乘积得到多组超参数。
 - 网格搜索使用每一组超参数训练模型，挑选验证集误差最小的超参数作为最好的超参数。
2. 如何确定搜索集合的范围？
 - 如果超参数是数值，则搜索集合的最小、最大元素可以基于先前相似实验的经验保守地挑选出来。
 - 如果超参数是离散的，则直接使用离散值。
3. 通常重复进行网格搜索时，效果会更好。假设在集合 $\{-1, 0, 1\}$ 上网格搜索超参数 α ：
 - 如果找到的最佳值是 1，那么说明低估了 α 的取值范围。此时重新在 $\{1, 2, 3\}$ 上搜索。
 - 如果找到的最佳值是 0，那么可以细化搜索范围以改进估计。此时重新在 $\{-0.1, 0, 0.1\}$ 上搜索。
4. 网格搜索的一个明显问题时：计算代价随着超参数数量呈指数级增长。
如果有 m 个超参数，每个最多取 n 个值，那么所需的试验数将是 $O(n^m)$ 。虽然可以并行试验，但是指数级增长的计算代价仍然不可行。

7.1.3 随机搜索

1. 随机搜索是一种可以替代网格搜索的方法，它编程简单、使用方便、能更快收敛到超参数的良好取值。
 - 首先为每个超参数定义一个边缘分布，如伯努利分布（对应着二元超参数）或者对数尺度上的均匀分布（对应着正实值超参数）。
 - 然后假设超参数之间相互独立，从各分布中抽样出一组超参数。
 - 使用这组超参数训练模型。
 - 经过多次抽样 -> 训练过程，挑选验证集误差最小的超参数作为最好的超参数。
2. 随机搜索的优点：
 - 不需要离散化超参数的值，也不需要限定超参数的取值范围。这允许我们在一个更大的集合上进行搜索。
 - 当某些超参数对于性能没有显著影响时，随机搜索相比于网格搜索指数级地高效，它能更快的减小验证集误差。
3. 与网格搜索一样，通常会基于前一次运行结果来重复运行下一个版本的随机搜索。
4. 随机搜索比网格搜索更快的找到良好超参数的原因是：没有浪费的实验。
 - 在网格搜索中，两次实验之间只会改变一个超参数（假设为 β ）的值，而其他超参数的值保持不变。
如果这个超参数 β 的值对于验证集误差没有明显区别，那么网格搜索相当于进行了两个重复的实验。

- 在随机搜索中，两次实验之间，所有的超参数值都不会相等，因为每个超参数的值都是从它们的分布函数中随机采样而来。因此不大可能会出现两个重复的实验。
- 如果 β 超参数与泛化误差无关，那么不同的 β 值：
 - 在网格搜索中，不同 β 值、相同的其他超参数值，会导致大量的重复实验。
 - 在随机搜索中，其他超参数值每次也都不同，因此不大可能出现两个重复的实验（除非所有的超参数都与泛化误差无关）。

7.2 调整原则

- 通常先对超参数进行粗调，然后在粗调中表现良好的超参数区域进行精调。
- 超参数随机搜索，并不意味着是在有效范围内随机均匀取值。需要选择合适的缩放来进行随机选取。

- 对于学习率，假设其取值范围为 `0.000001~1`。

如果进行均匀取值，取10个，那么有 90% 的随机值都位于区间 `[0.1,1]`。则 `[0.000001,0.1]` 之间没有足够的探索。这种做法明显不合理。

此时需要使用对数缩放，在对数轴上均匀随机取点。

- 对于指数加权移动平均的超参数 β 。假设其取值范围为 `0.9~0.9999`。

由于 $\frac{1}{1-\beta}$ 刻画了结果使用过去多少个周期的数据来加权平均。因此如果进行均匀取值，则：

- β 在 `0.9~0.9005` 之间取值时， $\frac{1}{1-\beta}$ 变化不大。
- β 在 `0.9990~0.9995` 之间取值时， $\frac{1}{1-\beta}$ 变化非常大。

β 越接近 1， $\frac{1}{1-\beta}$ 对于它的变化越敏感。此时，需要对 $1 - \beta$ 使用对数缩放，在对数轴上均匀随机取点。

- 如果选择了错误的缩放，如果取值的总量足够大，也可以得到不错的结果。

尤其当配合了 `粗调 -> 精调` 策略时，最终还是会聚焦到合适的超参数范围上。

- 通常情况下，建议至少每隔几个月重新评估或者修改超参数。因为随着时间的变化，真实场景的数据会逐渐发生改变：
 - 可能是由于用户的行为、偏好发生了改变。
 - 可能是采样的方式发生了改变。
 - 也可能仅仅是由于数据中心更新了服务器。

由于这些变化，原来设定的超参数可能不再适用。

- 有两种超参数调整策略：

- 如果数据足够大且没有足够的计算资源，此时只能一次完成一个试验。
则可以每天观察模型的表现，实时的、动态的调整超参数。
- 如果数据不大，有足够的计算资源可以同一时间完成大量的试验，则可以设置多组超参数设定，然后选择其中表现最好的那个。

八、传统机器学习的挑战

- 传统机器学习算法的两个困难：

- 维数灾难：当数据的维数很高时，很多机器学习问题变得相当困难。因为许多传统机器学习算法简单地假设：一个新样本的输出应该大致与最接近的训练样本的输出相同。
- 选择性偏好：某些算法偏好于选择某类函数。

最广泛的隐式偏好是：要学习的函数是平滑的或者局部不变性的。

这个先验知识表明：要学习的函数不会在一个小区域内发生较大的变化。很多简单算法完全依赖此先验知识来达到良好的泛化。