

Risco empírico x risco esperado

C

Vimos anteriormente que, dados pares entrada-saída (x_i, y_i) , $i = 1, \dots, m$, buscamos

$$\min_{w, b} R_m(w, b) = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m l(h(x_i; w, b); y_i)$$

onde l mede o erro na classificação do dado x_i ($h(x_i; w, b) \neq y_i$).

(R_m : risco empírico)

Mas isso é realmente o que queremos? 12

↳ na soma estão todas as possíveis entradas x ? Claro que não! Estamos querendo treinar uma rede neural justamente para responder a dados x desconhecidos ...

↳ x pode assumir coordenadas em conjuntos muito grandes, não enumeráveis até ...

↳ idealmente, podemos pensar " x contínuo".

Podemos pensar em termos de polaridade: cada lado (ou par (x, y)) "continuo" tem uma chance de ocorrer. Queremos que o computador responda corretamente "na média" dos x 's. Assim, "x" mais prováveis devem ter mais peso que os menos prováveis.

Isso nos leva à querer minimizar o valor esperado de má classificação.

↳ em outras palavras, queremos que L4
em média \hat{l} se aproxime do menor
valor possível (p. ex., zero se $l(z, y) = (y - z)^2$)

Esperança ou valor esperado

Notação:

- X — variável aleatória.
- x — amostra de X .

Exemplo: Suponha que X seja variável aleatória discreta com a seguinte distribuição de probabilidade: 5

| x | 0 | 100 | 200 | 300 | 400 |
|----------|-----|-----|-----|-----|-----|
| $P(X=x)$ | 0,2 | 0,1 | 0,4 | 0,2 | 0,1 |

→ probabilidade de $X=x$.

Pergunta: qual o valor médio de X em uma amostra de tamanho N ?

Resposta: ao amostrar $\times N$ vezes, 20% delas serão 0, 10% serão 100 etc.

A média será

$$\frac{1}{N} (0 \cdot 0,2N + 100 \cdot 0,1N + 200 \cdot 0,4N + 300 \cdot 0,2N + 400 \cdot 0,1N) = 190.$$

Assim, "a média a longo prazo" é 190 //

Para variáveis aleatórias discretas, definimos a esperança (ou valor esperado ou valor médio)

de X como sendo

(7)

$$E(X) = \sum x \cdot P(x).$$

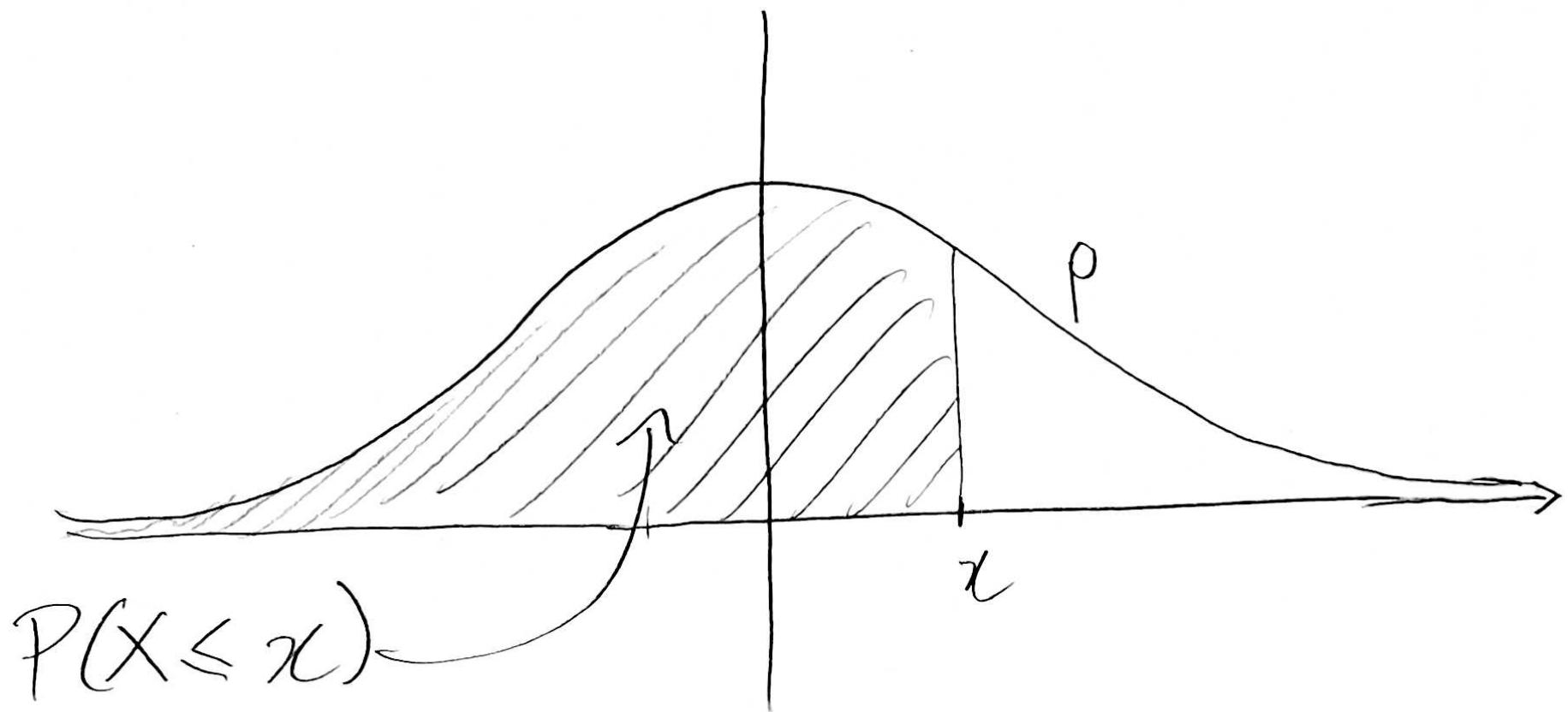
E se X for variável aleatória contínua?

Se p for a função densidade de probabilidade de X , então

$$E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} x p(x) dx = \int_R x p(x) dx.$$

Sembra -se que $\int_{\mathbb{R}} p(x) dx = 1$, $p(x) \geq 0$ e

$$P(X \leq x) = \int_{-\infty}^x p(x) dx.$$



Se $l: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ é uma função, podemos (a)
falar em valor esperado da variável
aleatória $Y = l(X)$:

$$E(Y) = E(l(X)) = \int_{\mathbb{R}} l(x) p(x) dx.$$

Agora, suponha que X ($\in \mathbf{x}$) sejam
vetores de n coordenadas, e

$$l: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}.$$

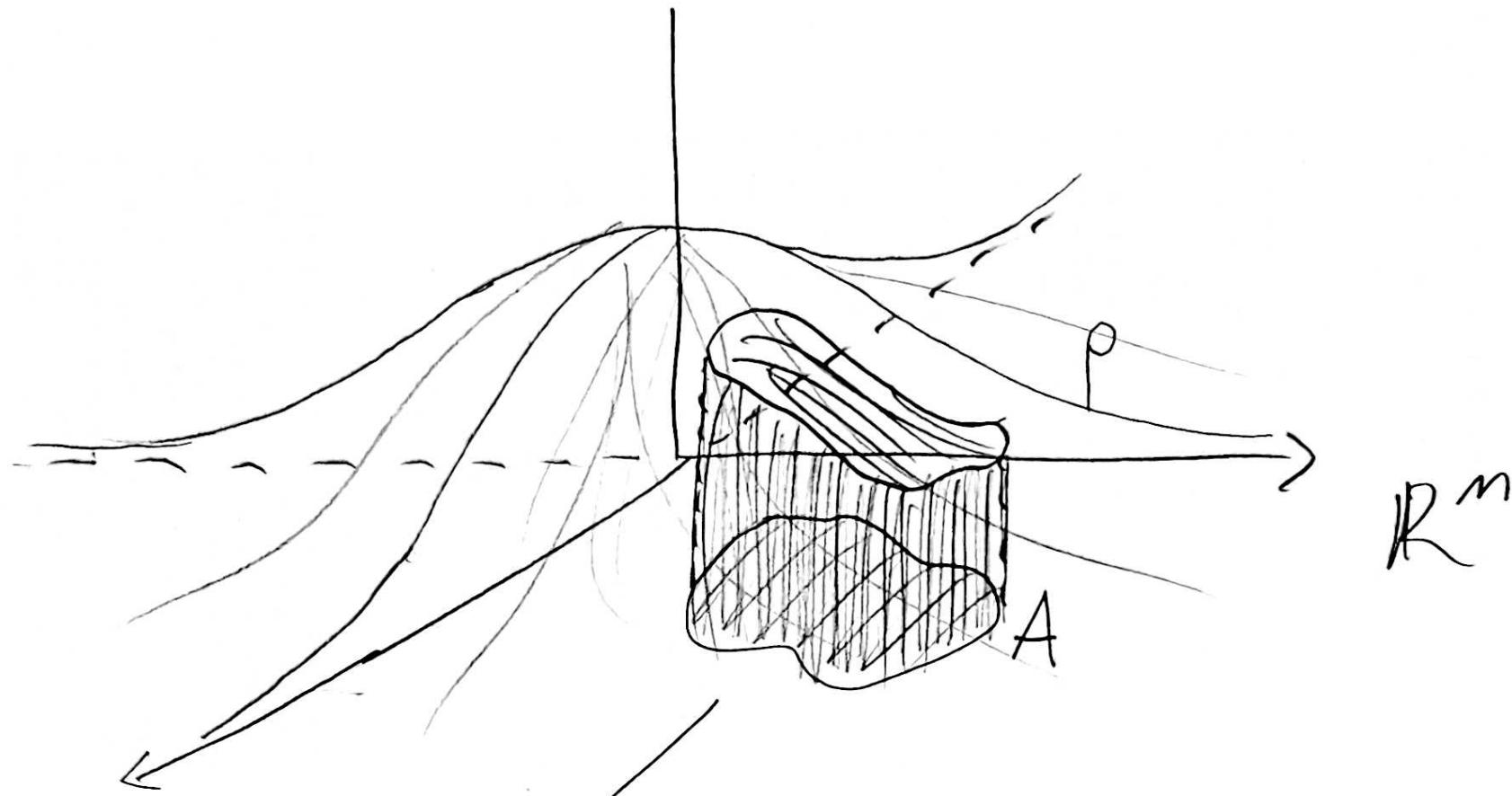
Assim, podemos falar em valor esperado E^{ρ} das imagens $l(x)$:

$$E(l(x)) = \int_{\mathbb{R}^m} l(x) \rho(x) dx$$

Aqui, $\rho: \mathbb{R}^m \rightarrow \mathbb{R}$, $\rho \geq 0$ e $\int_{\mathbb{R}^m} \rho(x) dx = 1$

(integrais múltiplas).

11



$$P(X \in A) = \int_A p(x) dx.$$

Verdadeiro objetivo: minimizar o risco esperado $R(w, b) =$ (12)

$$E(l(h(x; w, b); y)) = \int_{\mathbb{R}^m_x \times \mathbb{R}^m_y} l(h(x; w, b)) p(x, y) dx dy.$$

onde $p(x, y)$ é a função densidade conjunta das variáveis X e Y .

→ no caso discreto temos $P(x, y) = P(X=x \text{ e } Y=y)$

Quais os problemas?

(13)

- não sabemos quem é P ...
- só temos em mãos amostras (x_i, y_i) ,
 $i=1, \dots, m$, de (X, Y) .
- O que pode ser dito acerca de $E(\dots)$
a partir das amostras (x_i, y_i) ?
↳ ou, qual a relação entre risco
esperado $R(w, b)$ e empírico $R_m(w, b)$?

Fixados w, b , sabemos que [14]

$$|R(w, b) - R_m(w, b)| \xrightarrow{m \rightarrow \infty} 0$$

(lei dos grandes números). Isto é, tomando mais amostras, aproximamos melhor o risco esperado (razoável!).

Mas w, b variam!

(estamos procurando w^*, b^* — rede treinada).

Dale o seguinte:

L15

$$\sup_{w,b} |R(w,b) - R_m(w,b)| \rightarrow 0$$

(aumentar as amostras aproxima R uniformemente)

→ resultados apenas teórico, mas que pelo menos dá esperança que $\min R_m(w,b)$ tem relação com $\min R(w,b)$...

(na verdade não temos muita escolha : (

↳ de qualquer forma, queremos dizer (16) algo sobre a minimização de R , porque este é o objetivo real!

Pergunta:

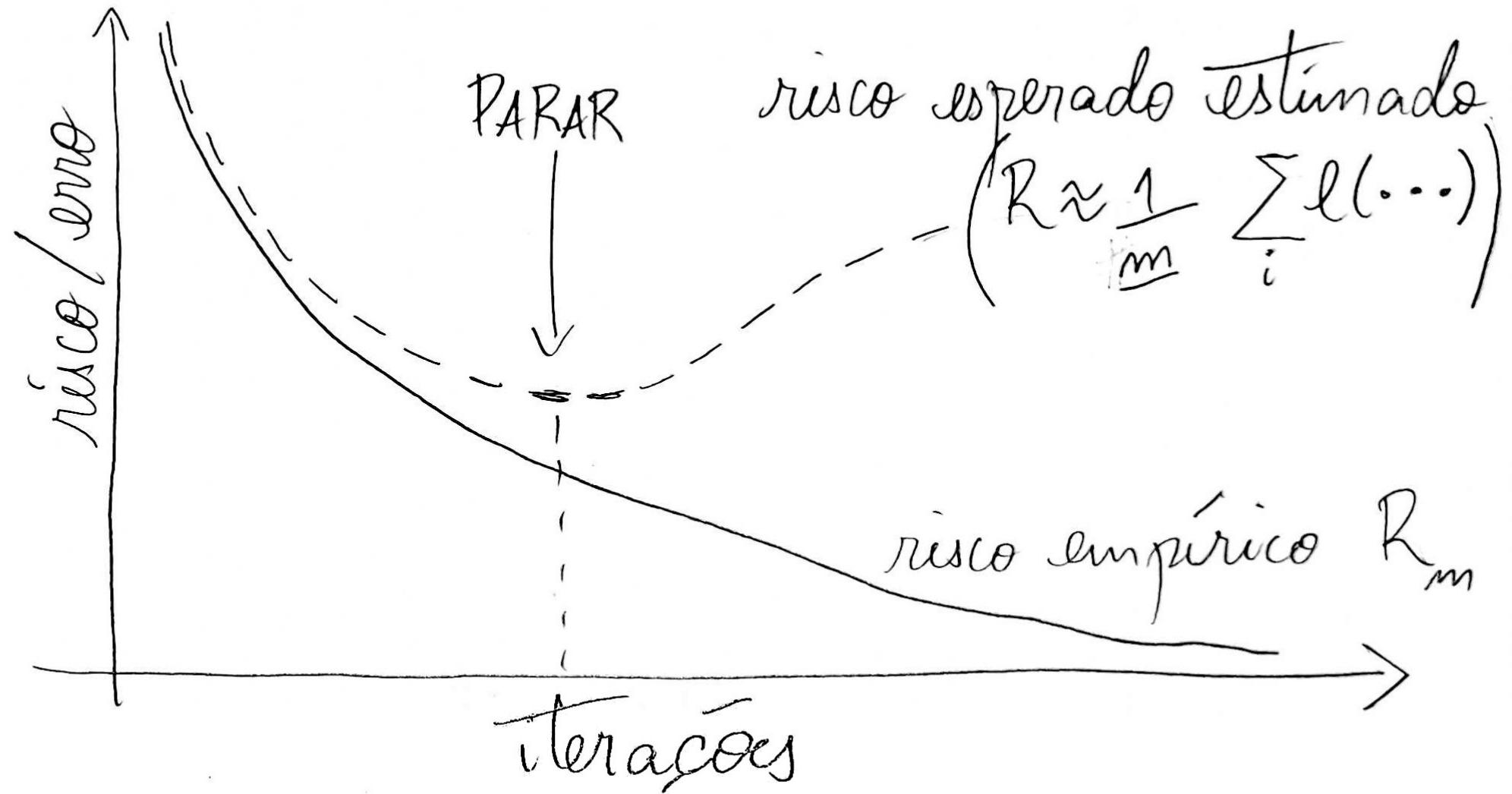
Conseguimos estimar de minimizar R_m estando minimizando R ?

Resposta : cross-validation

(12)

- Separamos parte dos dados, que não serão usados no treinamento.
(geralmente são poucos dados - $m \ll n$)
- Usamos esses dados para estimar R "on-line", durante a minimização de R_m
- Se R estimado começa a aumentar, paramos a minimização (caso $R_m \approx 0$)

18



Propriedades da esperança

(19)

1) $E(aW + c) = aE(W) + c$ (W aleatória; a, c , cte)

De fato,

$$E(aW + c) = \int_{\mathbb{R}} (aw + c) p(w) dw$$

$$= a \int_{\mathbb{R}} w p(w) dw + c \int_{\mathbb{R}} p(w) dw = aE(W) + c.$$

2) Em particular, $E(c) = c$.

$$3) E(W - E(W)) = 0 \quad (\text{exercício}) \quad (20)$$

"o valor esperado da diferença entre W e seu valor médio é 0"

$$4) E(X+Y) = E(X) + E(Y)$$

$$5) X \leq Y \Rightarrow E(X) \leq E(Y).$$

" $X \leq Y$ sempre"

$$6) |E(W)| \leq E(|W|) \quad (\text{exercício})$$

7) $E(\min\{X, Y\}) \leq \min\{E(X), E(Y)\}$. (21)

Variância

$$\text{Var}(W) = E((W - E(W))^2)$$

A variância é uma medida de dispersão da variável aleatória de sua média $E(W)$.

Propriedades:

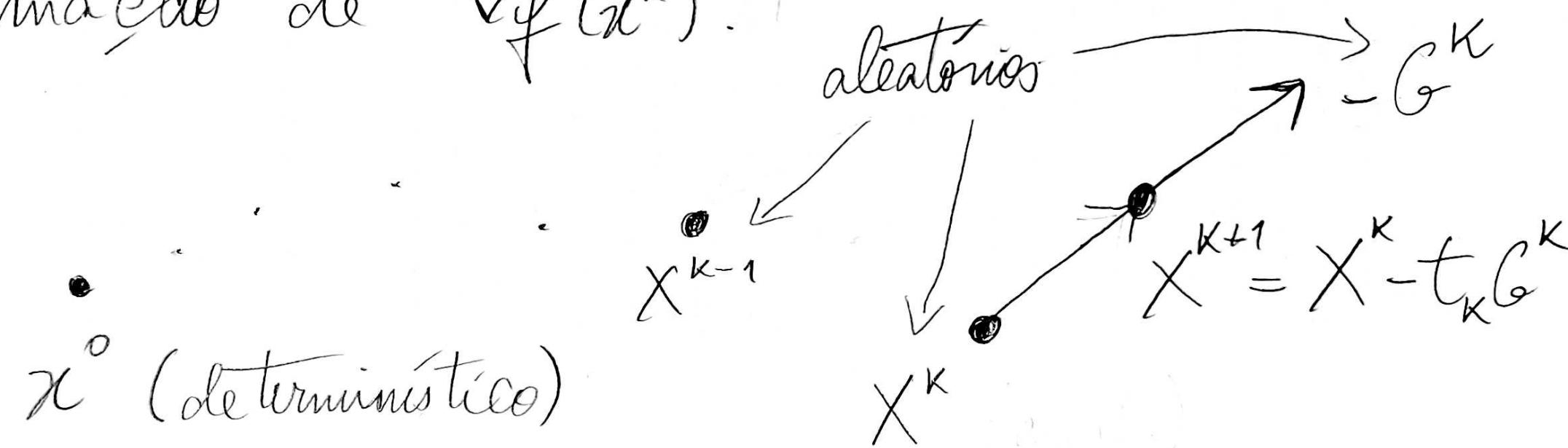
1) $\text{Var}(aW + c) = a^2 \text{Var}(W)$ (exercício)

2) $\text{Var}(W) = E(W^2) - (E(W))^2$ (exercício)

Esperança condicional

22

No método do gradiente estocástico, o passo $x^{k+1} = x^k - t_k g^k$ é feito com g^k escolhido aleatoriamente como aproximação de $\nabla f(x^k)$.



As variáveis aleatórias G^k e X^{k+1} L23

estão condicionadas à escolha $X^k = x^k$.

Portanto seu valor esperado também está!

Probabilidade condicional
(variáveis discretas)

$$P(w|z) = \frac{P(W=w \wedge Z=z)}{P(Z=z)}$$

Distribuição condicional
(variáveis contínuas)

$$p_{W|Z}(w|z) = \frac{f(w, z)}{p_Z(z)}$$

distrib. conjunta

A esperança condicional de W dado $Z=z$ (24)

$Z=z$ é definida de maneira análoga à E :

$$E(W|Z=z) = \int_{\mathbb{R}} w p_{W|Z}(w|z) dw$$

(análogo para \mathbb{R}^n).

Obs.: estamos supondo que $p_Z(z) > 0$, isto é, w tem chance de escolha com $Z=z$.

$$p_Z(z) = \int_{\mathbb{R}} p(w|z) dw.$$

Ligado, observe que para cada escolha $Z = z$, temos uma média de W condicionado à $Z = z$: $E(W|Z=z)$. Podemos considerar a função $\varphi(z) = E(W|Z=z)$ e a variável aleatória $\varphi(Z) = E(W|Z)$.

Essa é a esperança condicional de W dada Z

Propriedades da esperança condicional

(26)

- 1) $E(aX + cY | Z) = aE(X|Z) + cE(Y|Z)$
 $(X, Y, Z \text{ aleatórias}; a, c \text{ constantes})$
- 2) $E(c|Z) = c \quad (c \text{ constante})$
- 3) $X \leq Y \Rightarrow E(X|Z) \leq E(Y|Z)$
- 4) $|E(W|Z)| \leq E(|W| | Z)$

$$5) E(\min\{X, Y\} | Z) \leq \min\{E(X|Z), E(Y|Z)\}, \quad (27)$$

$$6) E(E(W|Z)) = E(W)$$

"O valor esperado da variável aleatória $\varphi(Z) = E(W|Z)$ é o valor esperado para W "