R2-Learn 用户手册

R2-Learn 用户手册

12 October 2018

目录

- 1. 概览
 - 1.1. 机器学习
 - 1.2. 使用 R2-Learn 进行机器学习
- 2. R2-Learn 入门
 - 2.1. 软件要求
 - 2.2. 导入数据
 - 2.2.1. 从数据库导入数据
 - 2.2.2. 导入本地文件
 - 2.3. 项目主页
 - 2.4. 模型部署主页
- 3. 开始一个新项目
 - 3.1. 创建一个项目
 - 3.2. 描述您的业务问题
 - 3.3. 处理您的数据
 - 3.3.1. 上传您的数据
 - 3.3.2. 清洗您的数据
 - 数据预览
 - 数据类型
 - 3.3.3. 目标变量
 - 3.3.4. 数据质量
 - 数据的常见问题
 - 自动修复目标变量
 - 手动修复目标变量
 - 所有数据质量
 - 3.4. 建模
 - 3.4.1. 自动建模
 - 3.4.2. 高级建模
 - 3.4.3. 建立您的模型
 - 模型选择
- 4. 部署模型

- 4.1. 部署
 - 4.1.1. 用数据源预测
 - 4.1.2. 用 API 预测
- 4.2. 监控已部署的模型
 - 4.2.1.运行监控
 - 4.2.2. 性能设定
 - 4.2.3. 性能状态
- 附录 A: 数据质量修复
 - A.1. 修复异常值
 - A.2. 修复缺失值
- 附录 B: 高级建模
 - B.1. 高级变量设置
 - B.2. 高级模型设置
 - B.2.1. 默认设置下创建/编辑模型设置
 - B.2.2. 选择算法
 - B.2.3. 设置最大模型集成大小
 - B.2.4. 训练验证留出和交叉验证
 - B.2.5. 重采样设置
 - B.2.6. 设置度量指标
 - B.2.7. 设置最大优化时间
 - B.2.8. 随机种子
- 附录 C: 二分类问题的模型选择
 - C.1. 简化视图
 - C.2. 高级视图
 - C.2.1. 顶部
 - C.2.2. 模型表
 - C.2.3. 其他模型细节
- 附录 D: 回归问题的模型选择
 - D.1. 简化视图
 - D.2. 高级视图
 - D.2.1. 顶部
 - D.2.2. 模型表
 - D.2.3. 其他模型细节

1. 概览

R2-Learn 可帮助公司快速将数据转换为机器学习模型,而无需 AI(人工智能)专业知识。 R2-Learn 采用最先进的技术,用 AI 全程助您使用您的数据创建模型,部署模型,实时迭代模型。

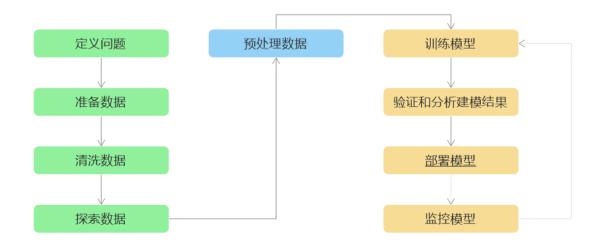
本节介绍机器学习的关键概念及其与 R2-Learn 的关系。

1.1. 机器学习

机器学习是 AI 的一个分支,其本质是训练计算机从数据中学习。随着算力的提升,机器学习可发现海量数据中深藏的模式和关系。目前正在开发机器学习模型,以对物体进行分类,检测异常,预测结果,并增加人的总体能力。现今机器学习模型已广泛地应用到物体分类,异常检测,预测结果,辅助增强人体能力等领域。

如何用机器学习辅助业务决策?常见工作流程如下:

- 1. 定义问题: 决定要用数据解决的问题。
- 2. 准备数据: 获取您要用于训练机器学习模型的数据集。
- 3. **清洗数据**:检查数据集中是否存在数据缺失和数据错误,用合适的方法修复数据集,提升数据质量。
- 4. 探索数据: 对数据有基本的了解,用于指导后续的分析和建模。
- 5. **预处理数据**: 修改数据集的格式, 使其适合后续生成机器学习模型。
- 6. 训练模型: 将数据用机器学习工具进行学习, 生成模型。
- 7. 验证和分析建模结果: 检查生成的模型是否能达到预期的预测效果。
- 8. **部署模型**:模型达到可用标准后,将模型进行部署。模型部署通常会使用 REST API 端口进行部署。当您有新的数据希望预测时,您可调用此端口,它 会为您返回预测结果。
- 9. **监控模型**:随着时间的推移,机器学习模型的表现会受到影响,从而影响其预测准确性。因此,您需要监控其性能,来确保预测结果的表现。

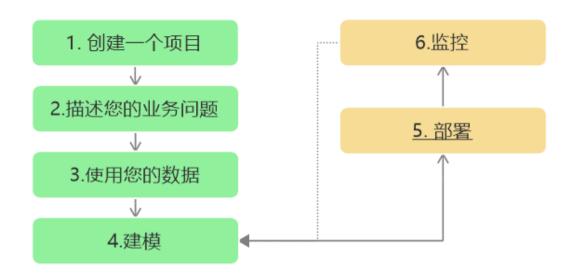


一个经验丰富的数据科学家会经历以上所有流程。这些流程中每一步和每一个关键 点做出的决策对于机器学习模型的质量都至关重要,模型的质量进而决定了预测的 表现。目前的数据科学家们要靠经验和直觉找到最佳的模型,这个过程可能会非常 的繁琐和缓慢,耗费极大,且可能会产生缺陷。

1.2. 使用 R2-Learn 进行机器学习

R2-Learn 是一个用 AI 进行大规模,自动化,标准化机器学习建模的平台,使机器学习的业务落地更方便,快捷,准确。

R2-Learn 机器学习工作流程如下:



- 1. **创建一个项目**:在 R2-Learn 中新建一个项目。
- 2. **描述您的业务问题**: 描述您想解决的业务问题,帮助您理清项目目标和预期结果。
- 3. 使用您的数据: 将您的训练数据集上传到 R2-Learn。 R2-Learn 使用机器学习来帮助您检查和清洗数据集。
- 4. 建模: 数据集加载至 R2-Learn 平台后,您可选择以下方式进行建模:
 - 自动建模: R2-Learn 使用训练集自动创建机器学习模型。
 - 高级建模: 您可自行选择变量,创建新变量,选择算法等创建新模型。
- 5. **部署**: 机器学习模型创建后, R2-Learn 将自动在您的服务器上部署模型, 并允许您:
 - 使用数据源预测: 将 R2-Learn 连接到您的数据库或上传 CSV 文件进行 预测。
 - 使用 API 预测: 使用 REST API 进行预测。

模型部署后,您可监控模型的预测性能,并在模型低于指定阈值时更新模型。

2. R2-Learn 产品入门

本章将带您创建您的第一个 R2-Learn 项目。要开始您的第一个项目,请点击新建项目。

2.1. 软件要求

谷歌 Chorme 浏览器 65 或者更新版.

2.2. 导入数据

您可以将数据导入 R2-Learn 中, 可用于:

- 构建机器学习模型,以及
- 对导入的数据进行预测。

R2-Learn 支持以下导入数据的方法:

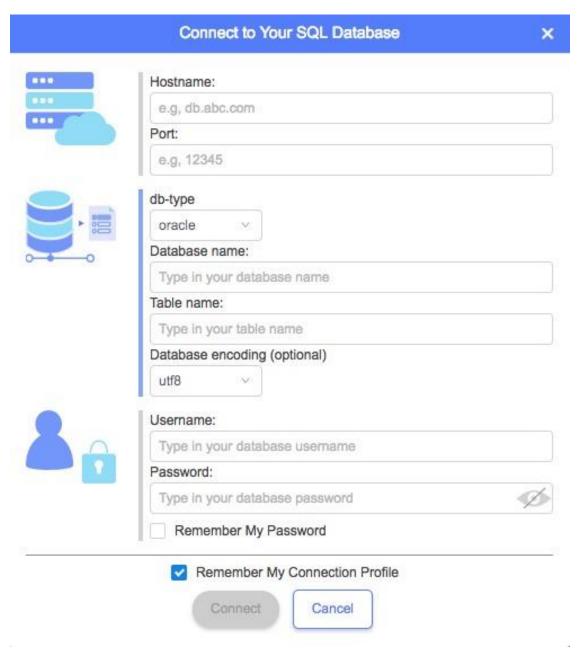
- 从数据库导入数据
- 导入本地文件

2.2.1. 从数据库导入数据

R2-Learn 支持从以下数据库导入数据:

- Oracle Database 11G
- Microsoft SQL Server
- MySQL

您的数据库必须支持 ODBC 11.2 链接。



2.2.2. 导入本地文件

您可导入 UTF-8 编码的 CSV 文件。该文件为训练集或输入数据。 您的 CSV 文件必须满足以下条件:

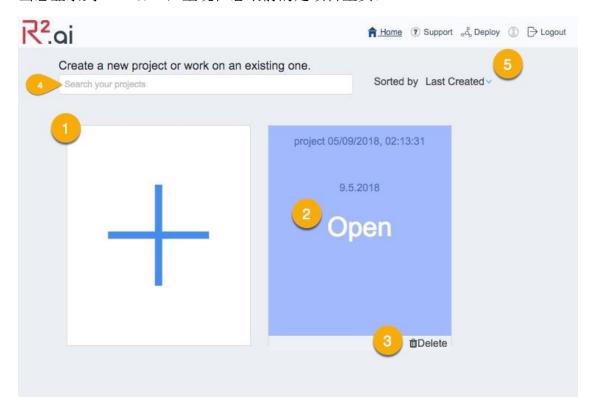
- 有一个标题行.
- 使用 UTF-8 编码。

备 如果您导入一个用于模型部署的 CSV 文件,则该 CSV 文件需满足以下条注 件:

- 需包含已部署的模型所需的所有变量,以及
- 文件中的变量名需要与训练集中的变量名相同。

2.3. 项目主页

当您登录到 R2-Learn,呈现在您眼前的是项目主页:



在项目主页里,您可以:

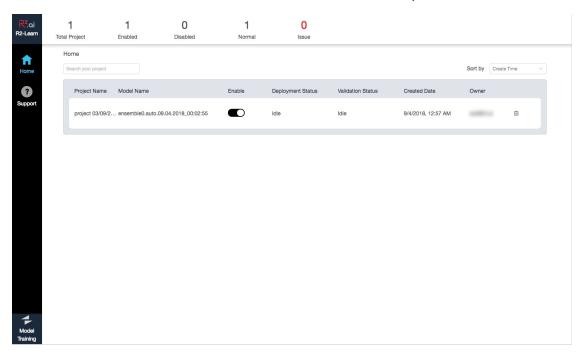
- 1. **创建** 新项目
- 2. 打开和编辑已存在的项目

- 3. 删除一个项目
- 4. 查找一个项目
- 5. 对项目排序**排序**.

点击页面顶端的部署, 您会进入模型部署主页。

2.4. 模型部署主页。

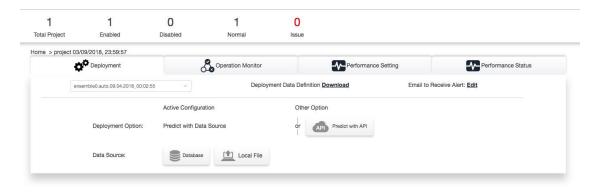
模型部署主页显示您创建的所有项目以及这些项目的部署/验证状态:



部署/验证状态:显示部署或验证任务的当前状态。会有:

- 正在运行:任务当前正在运行。.
- 空闲:项目没有正在运行的任务。
- 问题:项目在运行任务时遇到问题。请创建一个新案例。
- 已取消:项目下的案例已取消。

单击项目可打开:



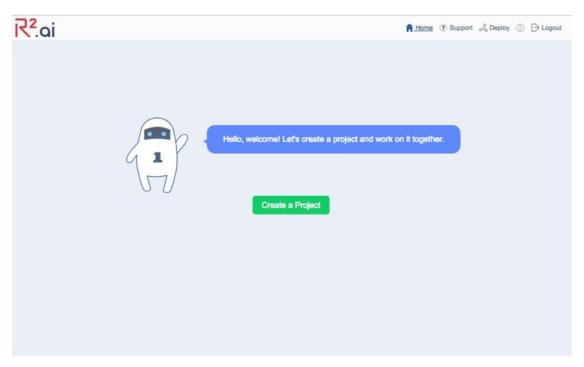
有关如何部署模型的更多信息,请参阅部署模型。

3. 开始一个新项目

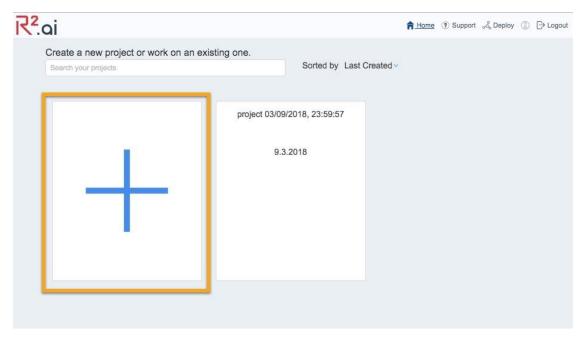
本章将向您介绍如何使用 R2-Learn 的自动建模功能建立一个新的机器学习项目。

3.1. 创建一个项目

当您首次登陆 R2-Learn 时,您将看到一个空的项目主页。单击"**创建项目**"以启动新项目。



如果您在 R2-Learn 上有现有项目,请单击加号以启动新项目。



您会进入项目部分, R2-Learn 会指引您:

- **命名您的项目。**每个项目都有一个默认的名称,其命名格式为《日/月/年,时:分,秒》,您可按需修改项目名称。
- **描述您的项目(可选)。**请输入您的简要项目说明。这会帮助您明确该项目 的目的。项目细节可记录在接下来的**业务问题**中的问题描述部分。

完成后,请点击继续按钮。

3.2. 描述您的业务问题

在业务问题部分,您将记录该项目的问题陈述和问题类型。

您可在项目的问题描述(可选)纷纷记录问题陈述和业务价值。这些记录有助于相 关部门的持续跟踪和评估。

在问题类型中,您可选择希望项目模型预测的类型:

- 对错(二分类):项目建立的模型将用于预测时间是否会发生。例如客户是否会购买该产品。
- **连续值(回归)**: 预测连续值/数值。例如根据给定的变量,预测转化一个客户的成本是多少。
- 一旦您设置好您的**业务问题**和**问题类型**后,点击**继续**进入下一步,将您的数据上 传到 R2-Learn 上。

3.3. 处理您的数据

现在我们开始处理您的数据,数据部分将引导您一起完成:

- 1. 首先在数据连接中上传您的数据。
- 2. 根据以下步骤清洗您的数据:
 - a. 数据预览,检查数据的标题行。
 - b. 数据类型, R2-Learn 会为您自动判断每列数据的数据类型。
- 3. 接下来,您可给 R2-Learn 指定您希望机器学习模型预测的目标变量。

4. 数据质量:

高质量的训练集对机器学习是至关重要的。您的训练集需包含尽量多的与目标相关的信息。它应只包含与业务问题相关的信息,且样本量尽可能大。您可请专家确认训练集的质量。R2-Learn 可用高质量的数据集完成机器学习其他所有工作。

当您上传数据后,R2-Learn 会检测数据类型,检查数据质量,并自动修复问题或提醒您手动修复。

3.3.1. 上传您的数据

您可在**数据连接**选项中上传数据集。"数据连接"选项允许您选择要用于机器学习模型的数据集。



如上图所示,您可将训练集加载至 R2-Learn 中。您可以用以下方式完成:

- 连接数据库,
- 上传本地文件。

若您刚开始了解 R2-Learn, 您可使用 R2-Learn 提供的训练数据集。

重要您上传的数据集必须包含标题行。

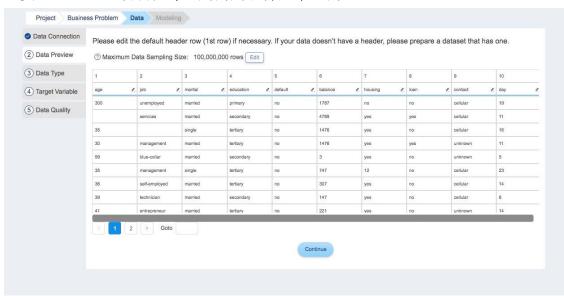
3.3.2. 清洗您的数据

数据预览

训练集加载完成后,R2-Learn 会在数据预览中随机展示训练集中的数据供您检查数据质量。您可按需进行以下修改:

- 编辑标题行
- 更改 R2-Learn 用于机器学习建模的最大样本数。

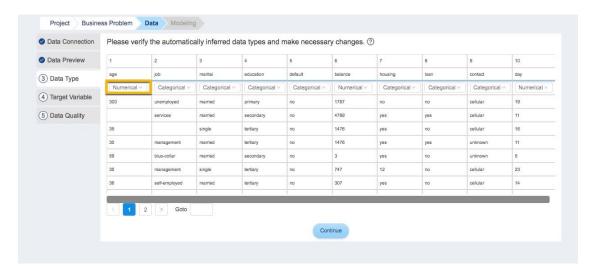
重要 您必须确认每一列的列名都是**唯一**的。



完成以上操作后,请单击继续,会进入数据类型。

数据类型

您需要确认 R2-Learn 为训练集中每列数据自动检测的**数据类型**。若某列数据类型 有误,请从该列的下拉菜单中选择正确的数据类型。



每列有 2 种可能的数据类型:

- 数值型: 当该列的数据为一系列数值时。
- 分类型: 当该列中的数据为不同的类别时。

重 数据类型的精确识别会影响机器学习模型。当您不确定某列数据的类别时, 要 请咨询数据集的提供者。

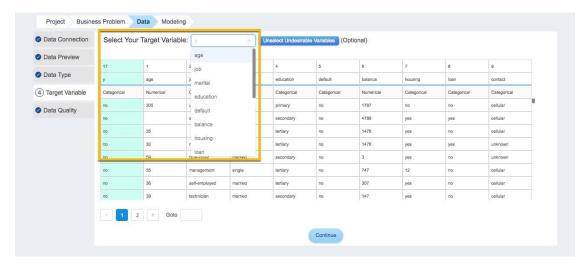
R2-Learn 会根据您上传数据方式的不同,用不同的方式识别数据类型:

- 当您从数据库中上传数据时, R2-Learn 将展示数据库中提供的数据类型。
- 当您从本地上传数据时,R2-Learn 会自动推断每列的数据。

完成以上操作后,单击继续,进入目标变量。

3.3.3. 目标变量

在**目标变量**中,我们需要选择我们希望机器学习模型预测的变量。目标变量的数据类型应与您在**业务问题**模块中设置的**问题类型**相匹配。



单击**选择目标变量**的下拉菜单,选择变量。

您可单击**反选不需要的变量**,该操作用于移除对目标变量没有贡献的变量,和与目标变量拥有一对一映射关系的变量,例如:

- ID
- 人名
- 产品名
- 目标变量的衍生变量
- 直接生成目标变量的变量

例如,在预测一个人的年收入的数据集中,我们可以直接移除人名,月收入。被移除的变量将变暗,并在后续模型训练中被移除。

完成以上操作后,单击继续,检查数据质量。

3.3.4. 数据质量

在**数据质量**中,R2-Learn 会检测数据中影响建模的问题,它会从以下两个方面检查数据质量:

- 目标变量质量: R2-Learn 会分析处理并显示目标变量的问题。
- 所有数据质量:目标变量质量问题修复后,R2-Learn 将会检查数据集的其他部分是否存在问题。

数据的常见问题

R2-Learn 会识别和修复以下两种问题:

• **目标变量有 2 个以上唯一值**: 在二分类业务问题中,目标变量必须有且只有 2 个不同的唯一值(通常为"是"和"否")。



- **数据类型错配**: 当变量的数据类型与之前设置的数据类型不匹配时,会有数据 类型错配警告。例如,某列标记为数值型的数据里有一些文本值。
- **缺失值**: 产生缺失值的原因既可能是数据未搜集,也可能是该数据点包含空值。 注意 空值表示缺少数据,没有数据存在,与 0 值不同。
- 异常值: 当某列为连续值时,若某数据点超出预期范围,会被认为是异常值。 检查异常值是不良的数据点还是真正的偏差非常重要。

以上这些问题的可修复方法,请参阅附录:数据质量修复。

目标变量质量

R2-Learn 会识别并修正目标变量中存在的问题。

自动修复目标变量

当 R2-Learn 发现目标变量中存在的问题是,它会这些问题展示在数据质量中:



单击下一步, R2-Learn 会自动修复问题, 或:

• 单击**编辑修复**,可修改 R2-Learn 修改目标变量中存在问题的方法。具体方法 详见附录:数据质量修复。

- 单击**重新选择目标变量**,将会返回目标变量选项中,您可选择新的目标变量。.
- 单击**上传新数据集**,将返回至数据连接,您可选择要使用的新数据集(要取 消此操作,请单击**数据质量**即可返回至当前页面)。

完成目标变量修复问题后,单击下一步继续所有数据质量部分。

手动修复目标变量

当 R2-Learn 在目标变量中遇到无法自动修复的问题时,它会在数据质量中将这些问题标记为需要操作,并在您进行下一步之前提示您进行修复。



如上图所示, 您会被提示用以下方法修复目标变量。

- 单击**重新选择我的目标变量**,可返回目标变量并选择新的目标变量。
- 单击上传新数据集,可返回数据连接,然后选择要使用的新数据集。(取消加载新数据集,请单击数据质量)
- 单击**修复**,可打开一个对话框,修复目标变量。

以上完成后,单击下一步,进入所有数据质量。

所有数据质量

目标变量质量问题解决后,R2-Learn 会继续检查其余所有变量的质量问题,并在此处显示结果。

R2-Learn 以提供默认修复方法。当您要自定义修复方法时,可进行以下操作:

• 单击**加载新数据集**可返回至数据连接,您可选择要是使用的新数据集。(要取消加载新数据集,请单击**数据质量**)。

• 选择**编辑修复**,会打开一个对话框,您可以自行选择修复数据的方式。



单击数据表,可查看数据中遇到的问题样例。

| age | job | marital | education | default | balance | housing | loan | contact | day |
|-----------|---------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-------------|-------------|-------------|----------|
| Numerical | Categorical | Categorical | Categorical | Categorical | Numerical | Categorical | Categorical | Categorical | Numerica |
| 0.02% | 0.02% | | | | | | | | |
| | services | married | secondary | no | 4,789 | yes | yes | cellular | 11 |
| 35 | | single | tertiary | no | 1,476 | yes | no | cellular | 16 |
| 300 | unemployed | married | primary | no | 1,787 | no | no | cellular | 19 |
| 30 | management | married | tertiary | no | 1,476 | yes | yes | unknown | 11 |
| 59 | blue-collar | married | secondary | no | 3 | yes | no | unknown | 5 |
| 35 | management | single | tertiary | no | 747 | 12 | no | cellular | 23 |
| 36 | self-employed | married | tertiary | no | 307 | yes | no | cellular | 14 |
| 39 | technician | married | secondary | no | 147 | yes | no | cellular | 6 |
| 11 | entrepreneur | married | tertiary | no | 221 | yes | no | unknown | 14 |
| 43 | services | married | primary | no | -88 | yes | yes | cellular | 17 |

关于常见修复方法,请参阅附录:数据质量修复。

注意 保存对数据的更改可能会花 1-2 分钟,请耐心等待。

以上完成后,请单击继续,开始建模。

3.4. 建模

- 自动建模,或
- 高级建模

3.4.1. 自动建模

自动建模会根据您处理过得训练集,自动为您构建机器学习模型。单击自动建模, R2-Learn 将为您构建模型。

3.4.2. 高级建模

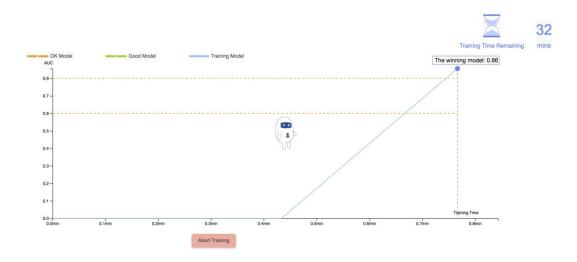
当您选择**高级建模**时,您可以更详细的控制建模过程。具体信息请参阅附录:高级建模。

3.4.3. 建立您的模型

完成上述所有建模前的配置, R2-Learn 将开始建造您的机器学习模型。

R2-Learn 将在建模过程中向您显示性能时间图:

- 二分类模型: 随着训练时间的递增, AUC(曲线下面积)的变化:
 - "OK Model" 行: 超过此行,表明机器学习模型已经超过了通常可接受的性能水平
 - "Good Model" 行: 超过此行,表明机器学习模型的已经拥有了良好的性能水平。
 - "Training model" 行: 这条线显示了目前性能最佳的机器学习模型。
- 回归模型:随着训练时间地增,MSE(均方误差)的变化。
 - "Training Model" 行: 此行显示了目前性能最佳的机器学习模型的表现。



单击中止训练,可取消魔性训练。

模型训练所需的剩余时间在页面最右侧。训练完成时,请给 R2-Learn 一些时间构建最终模型,并生成模型训练报告。

如果 R2-Learn 无法从给定的训练数据集中训练出足够高效的机器学习模型,则模型训练过程可能会失败。如果模型训练失败,则必须重新配置项目以修复数据集质量问题,或选择新的或更大的数据集。

模型选择

模型训练完成后,在**模型选择**部分,R2-Learn 会展示模型训练结果。根据您不同的问题陈述,您可看到不同的图表:

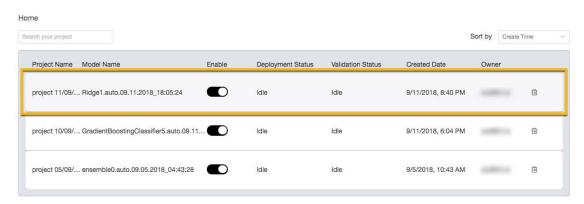
- 附录:二分类问题的模型选择
- 附录:回归问题的模型选择

模型选择后,单击部署,进行模型部署。

4. 部署模型

通过部署模型,您可以对新的数据进行预测。这经常涉及到 REST API 端口。您可以将数据发送到该端口,并从中接收预测。

R2-Learn 为您自动处理模型部署。一旦您成功地创建了机器学习模型,您可以点击其中包含的项目来访问已部署的模型:



在开放的项目中, 您可看到以下部分:

- 部署
- 操作监控
- 性能设置
- 表现状态

此外,您可访问以下:

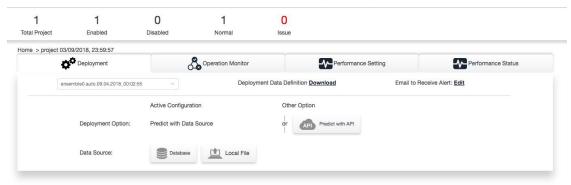


- 正在使用的模型:选择要运行部署或其他操作的模型。
- **部署数据定义:** 单击"下载",可以下载包含模型使用的变量列表的 CSV 文件。
- 电子邮件接收警报:单击可以输入电子邮件地址,可发送与部署相关的警报。

4.1. 部署

当您在模型部署主页打开一个项目时,您会进入模型部署。您可以选择使用已部署模型的方式:

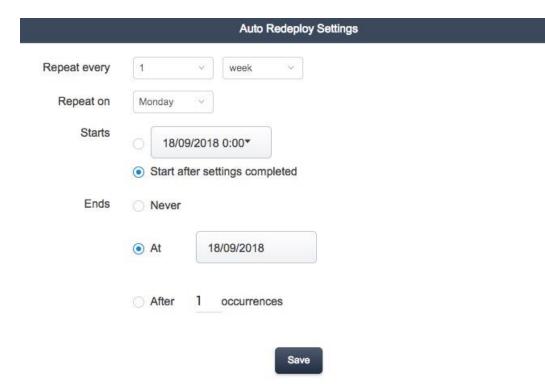
- 使用数据源预测:使用本地文件或数据库中的数据进行预测。
- 使用 API 预测:使用 R2-Learn 的 REST API 将数据发送到 R2-Learn 进行预测。
- 重 导入的数据必须与所使用的机器学习模型具有相同的变量。要下载包含导入 要 数据集中所需变量列表的文件,请单击**部署数据定义**旁边的**下载**。



4.1.1. 用数据源预测

要对从数据源导入的数据进行预测:

- 1. 单击使用数据源预测。
- 2. 选择要从以下位置导入数据的数据源:
 - 数据库: 请提供链接的详细信息。请参阅从数据库导入数据。
 - **本地文件**: 将文件上载到 R2-Learn, 其中包含要在其上运行预测的数据。 有关更多信息,请参阅导入本地文件。
- 3. 选择结果位置,模型预测的结果会保存在结果位置上:
 - **在 App** 中: 在 R2-Learn 中保存并显示结果。
 - 上传到数据库:将结果写入给定数据库。
- 4. 选择**部署频率**。R2 会根据此频率进行部署:这告诉 R2-Learn 如何安排部署:
 - 一次性
 - **自动重复**:请为您的部署设置一个定期重复计划。



- 故**障时自动禁用**: 若 R2-Learn 出现故障时,请选择此项,会停止部署。

4.1.2. 用 API 预测

在 R2-Learn 中部署机器学习模型时,会自动生成 REST API 端点,您可据此发出请求。

使用 R2-Learn 的 REST API 进行预测前, 您需要有:

- R2-Learn API KEY;
- 您的 R2-Learn 用户名;
- 您的 R2-Learn 项目名;例如,项目 project 11/09/2018, 18:04:13。
- 您的 R2-Learn 模型名称。例如,Ridge1.auto.09.11.2018_18:05:24。

使用带有 cURL 的 R2-Learn 的 REST API 进行预测,并将结果保存到 output.csv 时,请在终端运行以下命令:

curl -F 'data=@path/to/local/file' http://service2.newa-tech.com/api/us
er_name/project_name/model_name/api_key -o output.csv

您需要项目名称和模型名称的 URL 编码版本,并将其写入请求中。例如,项目 11/09/2018, 18:04:13 的 URL 编码字符串为 project%2011%2F09%2F2018%2C%2018%3A04%3A13,模型 Ridge1.auto.09.11.2018_18:05:24 的 URL 编码字符串为 Ridge1.auto.09.11.2018_18%3A05%3A24.

您生成的 cURL 请求格式应如下所示:

curl -F 'data=@/home/r2user/input_data.csv' http://service2.newa-tech.c
om/api/r2user/project%2011%2F09%2F2018%2C%2018%3A04%3A13/Ridge1.auto.09.
11.2018_18%3A05%3A24/apikey912ec803b2ce49e4a -o /home/r2user/output.csv

您也可用 Python 写 API 请求:

```
# API code
import requests
# Make predictions on your data
data = {"file": open('/path/to/your/data.csv', 'rb')}
Response = requests.post('http://service2.newa-tech.com/api/<user_name>
/<project_namr>/<model_name>/<api_key>', data)
```

4.2. 监控已部署的模型

您可使用以下功能监控和调整已部署的模型:

- 运行监控
- 性能设定
- 性能状态

4.2.1. 运行监控

此页面展示了所有与模型有关的运行信息。对于每次运行,都会显示以下信息:

- 模型名称:运营的模型名称:
- 开始时间:运行开始时间;
- 结束时间: 运行结束时间:
- **部署方式**: R2-Learn 如何连接到输入数据: 通过数据库连接,或上传本地文件,或 API 请求:
- 状态:运行状态;
- 结果: 运行结果。

此外,每个操作都有以下选项:

- 下载结果:操作完成后,您可以下载结果数据。届过数据中附加了额外的列, 其名字为"<target_variable_name>_pred"。它是对每个数据点的预测值。
- 取消正在进行的操作: 中止运行。

4.2.2. 性能设定

您可以上载验证数据集来验证该模型的性能。

您可用以下方式上传验证数据集:

- 从数据库导入数据
- 导入本地文件

验证指标有以下几种:

- **度量指标**: 用验证数据集运行模型时,您可使用度量指标来衡量模型的表现
 - 二分类模型:选择精度或 AUC 作为度量指标。
 - 回归模型:选择 RMSE 或 R² 作为度量指标。
- 标准阈值: 您可为已部署数据的性能设置一个标准阈值。若验证模型的性能低于此阈值,则 R2-Learn 会发出警报。
- 部署频率:您可以在此处安排重复操作。
- 故障时自动禁用: 启用此选项可将操作设置为在遇到任何问题时终止。

4.2.3. 性能状态

您可在此处监控任何正在运行或已完成的操作的状态。此处显示以下信息:

- 模型名称: 运营的模型名称:
- 开始时间:运行开始时间;
- 结束时间:运行结束时间;
- 性能:
 - 回归模型:显示模型的 R² 和 RMSE.
 - 二分类模型:显示 AUC 和精度
- 阈值: 您在性能设定里设置的阈值
- **结果 Results**: 操作完成后,您可以下载结果数据。届过数据中附加了额外的列,其名字为"<target_variable_name>_pred"。它是对每个数据点的预测值。

附录 A: 数据质量修复

R2-Learn 可能标记的数据质量问题包括:

- **数据类型错配:** 当变量的数据类型与之前标记的数据类型不匹配时,它会发出数据类型不匹配警告。例如,如果之前标记该变量为分类变量,但其实际为数字变量。
- 缺失值:数据中的缺失值可能是由于数据收集时的错误或空值。

注意 空值表示缺少数据("无值"),与"零值"不同。

 异常值:数据点超出给定数据集的预期范围。检查异常值的数据点并确定它们 是否与数据或坏数据点中显示的趋势完全不同是很重要的。

在数据质量中, R2-Learn 可帮助您使用以下方法解决这些问题:

- 修复异常值
- 修复缺失值

A.1. 修复异常值

- 编辑有效范围
 - 使用我们的规则引擎,系统会自动的从数据集中推断出变量的合理范围,并将范围外的值视为异常值。手动编辑有效范围,可以扩展或收缩 R2-Learn 接受的值范围。

• 边界值替换

- 用边界值替换异常值。
- 仅适用于数值型变量。
- 例如,如果有一列的值为[1,50,60,70,1000],其合理边界为(40,80),那么**边界值替换**会将异常值[1]和[1000]替换为[40]和[80],则这列的值变成了[40,50,60,70,80]。

• 保留

- 保留异常值。
- 仅适用于数值变量。

• 均值替换

- 将异常值替换为该列中有效范围内所有值的平均值。
- 仅适用于数值变量。

- 例如,如果有一列的值为[1,50,60,70,1000],其有效范围为(40,80),则异常值[1]和[1000]将替换为值[60],则这列的值变成了[60,50,60,70,60]。

• 中值替换

- 将异常值替换为该列中有效范围内所有值的中位数值。
- 仅适用于数值变量。
- 例如,如果有一列的值为[1,6,5,8,50],其有效范围为(3,10),则异常值[1]和[50]将替换为值[6],则这列的值变成了[6,6,5,8,6]。

删除行

- 删除包含异常值的行。

• 0 值替换

- 将异常值替换为 0。
- 仅适用于数值变量。

A.2. 修复缺失值

• 替换最常见的值

- 仅适用于分类变量。
- 例如,如果有一的值为[1,2,5,3,2],则所有缺失值将设置为类别 2。

• • 替换为新的唯一值

- 用一个全新的唯一值作为一个新类别,来替换缺失值。
- 仅适用于分类变量。

平均值替换

- 将缺失值替换为列中剩余值的平均值。
- 仅适用于数值变量。
- 例如,如果有一列具有以下非缺失值[4,6,8],则所有缺失值将替换为值 6。

• 中值替换

将缺失值替换为列中剩余值的中位数。

- 仅适用于数值变量。
- 例如,如果有一列具有以下非缺失值[6,5,8],则所有缺失值将替换为值 6。

• 删除行

- 删除包含缺失值的行。

• 0 值替换

- 用 0 替换缺失值。
- 仅适用于数值变量。

• 为什么缺失?

- 您可以要求 R2-Learn 为您修复缺失的值。选择以下三个选项之一来告 知 R2-Learn 缺少值的原因,让 R2-Learn 自动修复缺失值:
 - "我不知道"
 - "故意留空"
 - "无法收集数据"

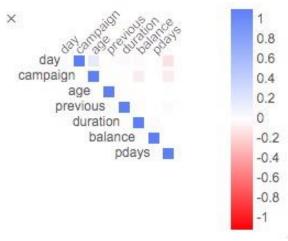
附录 B: 高级建模

当您选择**高级建模**时,可以配置以下设置:

B.1.高级变量设置

这里您可以修改数据中的变量以更改模型。您可以在**高级变量设置**中更改以下内容:

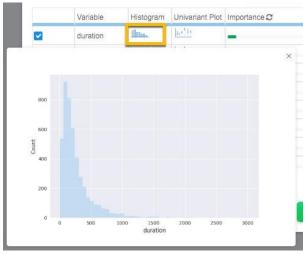
- **选择/取消选择变量:** 您可以选择其他变量或从数据集中删除变量。构建机器 学习模型后, 您可以在模型选择部分中查看变量选择的更改如何影响模型。
- **检查关联矩阵**:单击**检查关联矩阵**以显示一个小图,该图显示数据集中具有最强相关关系的 15 个变量之间的相关强度。相关性越强,颜色越冷(更接近蓝色)。冷色(蓝色阴影)表示正相关,而暖色(红色阴影)表示负相关。



- **创建新变量**: 单击**创建新变量**向模型添加新变量。此新变量可以是现有变量 的组合,也可以是对现有变量执行的操作。要创建新变量:
 - a. 单击**创建新变量**。
 - b. 输入新变量的唯一名称。
 - c. 单击等号("=")后面的字段,打开列出所有可能操作的下拉菜单。 您可以对现有变量执行以下操作以创建新变量:
 - 分组和计算
 - 组合变量
 - 比较值
 - 累积值
 - log()
 - 其他运算: +,-,*,/

注意 有关这些操作的详细信息,请在选择操作时单击"查看提示"。

• **直方图/条形图**: 单击变量的"直方图"会显示一个图形,显示变量的所有值的分布。数值变量显示为直方图,分类变量显示为条形图。



• 单变量图: 单击变量的"单变量图"会显示一个图形,显示该变量值的分布。



• **变量重要性**: 变量重要性部分表示目标变量对预测变量的统计学显著性;变量的"重要性"越高,该变量的变化就越会影响预测的目标变量。默认情况下, 高级变量设置中显示的变量从最高到最低"重要性"排序。

B.2. 高级建模设置

在这里,您可以为模型构建配置其他设置:

B.2.1. 默认状态下创建/编辑模型

单击**高级建模**时,R2-Learn 会创建一个新的"模型设置"。在**高级建模设置**中,新模型设置为:

- 1. 默认名称"custom.<MM.DD.YYY_HH:MM:SS>"
- 2. 将{select}区域设定为此新模型的设置。

您可在{select}字段中选择它来构建先前定义的"模型设置"。 在"命名模型设置"字段中更改名称,将修改后的模型设置另存为新模型设置。

B.2.2. 选择算法

R2-Learn 默认使用以下所有算法来构建模型。您可以删除一些算法,加快建模速度。以下是针对不同问题可选择的算法列表::

| 算法 | 二分类 | 回归 |
|--|--------------|--------------|
| Adaboost | ✓ | √ |
| ARD (Automatic Relevance Determination) Regression | | ✓ |
| Bernoulli Naive Bayes | \checkmark | |
| Decision Tree | \checkmark | \checkmark |
| Extra Trees | \checkmark | \checkmark |
| Gaussian Naive Bayes | \checkmark | |
| Gaussian Process | | \checkmark |
| Gradient Boosting | \checkmark | \checkmark |
| K Nearest Neighbor | \checkmark | \checkmark |
| Linear Discriminant Analysis | \checkmark | |
| Multinomial Naive Bayes | \checkmark | |
| Passive Aggressive | \checkmark | |
| Quadratic Discriminant Analysis | \checkmark | |
| Random Forest | \checkmark | \checkmark |
| SGD (Stochastic Gradient Descent) | \checkmark | \checkmark |
| Logistic Regression | \checkmark | |
| Ridge Regression | | \checkmark |

B.2.3. 设置模型集成大小

您可在此设置模型集成的算法数量。例如,当**最大模型集成数量**设置为 3 时,最多会有 3 种算法集成在一个模型里。您最终生成的模型中所包含的算法数量还取决于您设置的训练时长。

B.2.4. 训练验证留出和交叉验证

您可以选择使用以下方法构建机器学习模型:

- 训练验证留出:通过将训练数据集划分为三个子集来构建机器学习模型:
 - 训练集:用于构建机器学习模型:
 - 验证集: 用于调整分类器的超参数,以达到更高的准确性;
 - **留出集**:用于评估模型的准确性。它并不参与模型构建,只用于验证已构建的模型。

您可以拖动的方式设置每个子集占数据集的百分比。

- **K-fold 交叉验证留出:** 通过以下方法构建机器学习模型:
 - a. 将训练数据集划分为"k"个"折叠"或"k"个相同大小的子样本集;
 - b. 在建模过程中,每个 'k' 子样本集将作为验证集,其余 'k-1' 个子样本集作为训练集;
 - c. 建模过程将重复'k'次,给出'k'个模型:
 - d. 我们会平均'k'个模型,以生成单个模型。

此方法会比**训练验证留出**花费更长的时间。您可设置折叠数,和留出百分比。

B.2.5. 重采样设置

注意 仅适用于二分类模型

若目标变量的结果分布不均衡,则数据集不平衡。

R2-Learn 可通过对训练集进行**上采样**或**下采样**来平衡数据集。对于上采样和下采样,您可调整比例。

B.2.6. 设置度量指标

您可选择判断机器学习模型性能的度量指标。

- 二分类模型,您可选择:
- AUC(曲线下面积)(默认)
- Accuracy
- F1

回归模型, 您可选择:

- MSE (均方差) (默认)
- R²

B.2.7. 设置最大优化时间

您可以设置优化模型构建参数的最大优化时间。设置的优化时间越长,生成的机器学习模型的性能越好。对于较大的训练数据集,我们建议您设置更高的最大优化时间。

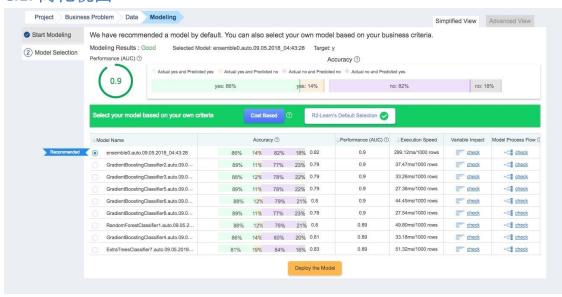
系统会为您自动计算一个最低的优化时间。

B.2.8. 随机种子

训练机器学习模型时,将会在生成随机数时将随机数设置为您设定好的随机种子。 此举可使模型可复现。

附录 C: 二分类问题的模型选择

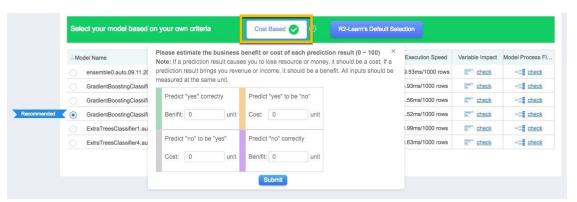
C.1. 简化视图



在二分类问题中的模型选择中,会显示以下内容:

- 建模结果: 显示了模型的性能水平。
- **所选模型:** 您当前选择的机器学习模型。这是从下面显示的经过训练的机器 学习模型列表中选择的。
- 目标: 机器学习模型预测的目标变量。

- **性能:**显示所选模型的性能。二分类模型中通常是 AUC(曲线下面积)。
- 准确性:显示所选模型预测的准确性。
- 根据您自己的标准选择模型: R2-Learn 从模型列表中自动选择最适合您业务问题的模型。您可以选择其他方式: 通过选择以下选项之一来修改其选择推荐的方式:
 - **R2-Learn 的默认推荐**: R2-Learn 会根据执行时间和性能之间的平衡, 给出推荐。
 - **基于成本**: 此处,您可量化假阳性(第一类错误)和假阴性(第二类错误)会产生的业务损失,以及从真阳性和真阴性获得的收益。R2-Learn 将据此给您推荐模型。



- 训练模型列表: 此处还显示了使用训练数据构建的模型列表。列出的模型各有 一个:
 - **模型名称**:此模型的名字。通常为 "<algorithm_name>.<model_setting_name>"。若您选择自动建模时, <model_setting_name>会自动为您创建。若您选择了高级建模, 您可自行设定名称。
 - 准确度:显示模型预测结果与实际结果的匹配程度。准确度越高,模型 预测的效果越好。
 - **性能**:显示此模型的性能指标。二分类模型通常为 AUC(曲线下面积), 回归模型通常为 MSE(均方差)。
 - **执行速度**: 每处理 1000 行数据,模型需要花费的时间。
 - **变量影响**:单击**查看**,可查看每个模型变量对目标变量的影响。 该值 越高,说明该变量的变化对模型预测的结果的影响越大。
 - **模型流程**: 单击**查看**,可看到此模型构建的每一步流程和详细处理方法。

C.2. 高级视图

| Start Modeling | Modeling Results : Good | | | | | | | | | |
|-------------------|----------------------------------|-----------|-------------|-----------|--------------------|---------------|---------------|------------|------------------|---------|
| 2 Model Selection | Model Name Contains All | | | | | | | | | |
| | ↓ Model Name | ↓F1-Score | Precision (| ↓Recall ⑦ | Cutoff Threshold ① | Variable List | Training Size | Validation | Cross Validation | Holdout |
| Recommended | GradientBoostingClassifier5.auto | 0.55 | 0.41 | 0.81 | 0.09 | All Variables | 60% | 0.9 | N/A | 0.91 |
| | ensemble0.auto.09.11.2018_04:0 | 0.53 | 0.38 | 0.88 | 0.11 | All Variables | 60% | 0.9 | N/A | 0.91 |
| | ExtraTreesClassifier1.auto.09.11 | 0.53 | 0.39 | 0.79 | 0.47 | All Variables | 60% | 0.89 | N/A | 0.91 |
| | GradientBoostingClassifier2.auto | 0.5 | 0.35 | 0.88 | 0.05 | All Variables | 60% | 0.9 | N/A | 0.91 |
| | GradientBoostingClassifier3.auto | 0.5 | 0.35 | 0.9 | 0.05 | All Variables | 60% | 0.9 | N/A | 0.91 |
| | ExtraTreesClassifier4.auto.09.11 | 0.49 | 0.34 | 0.87 | 0.11 | All Variables | 60% | 0.89 | N/A | 0.91 |

用户可以使用高级视图查看有关可用于部署的模型的更多详细信息。

C.2.1. 顶部

顶部显示以下内容:

- 建模结果.: 模型的泛化表现。
- 模型内容包含: 您可根据算法和模型设置筛选模型
- **模型比较图表:**每个模型的表现,可用于进行模型性能比较:
 - **速度 v.s.准确性**:每个模型的速度和准确性的表
 - 提升图:通过比较使用模型和不是用模型预测结果的比率,可用于确定模型的有效性。
 - **ROC 曲线**: 根据不同阈值,确定二分类模型的分类能力。

C.2.2. 模型表

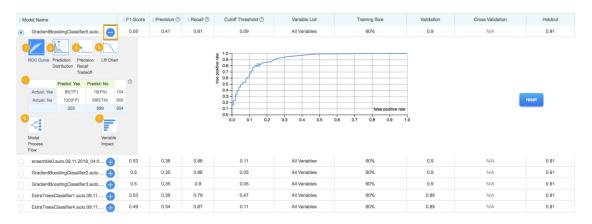
下表显示了使用数据集训练的所有模型。每个列出的模型都有:

- **模型名字:** 此模型的名字。通常为 "<algorithm_name>.<model_setting_name>"。若您选择自动建模时, <model_setting_name>会自动为您创建。若您选择了高级建模,您可自行设定 名称。
- **F1 值**: F1 值是一个综合指标,结合了准确率和召回率。当准确率和召回率都高时,F1 值也会高。其计算方法为:F1 = 2 * 准确率 * 召回率/(准确率 + 召回率).
- 准确率: 描述的是在被识别为正类别的样本中,确实为正类别的比例。其计算方法为: Precision = TP/(TP+FP).
- 召回率: 描述的是在所有正类别样本中, 被正确识别为正类别的比例。其计算方法为: Recall =TP/(TP+FN).

- 截止阈值:一些模型会返回概率值,将这些值映射到二元类别时,需指定分类阈值。
 若值高于该阈值,则认为是正类别。若值低于该阈值,则认为是负类别。
- 变量列表:显示训练数据集中的哪些变量包含在模型中。
- **验证/交叉验证**:验证/交叉验证数据集是用于微调初始模型,可查看变量之间的关系是否正确操作,以创建可能的最佳模型的数据。
- **留出:** 留出集是为模型的最终测试留出的一部分原始数据,用于评估模型的 执行情况。

C.2.3. 其它模型细节

要查看其他模型详细信息,请单击模型名称旁边的+。

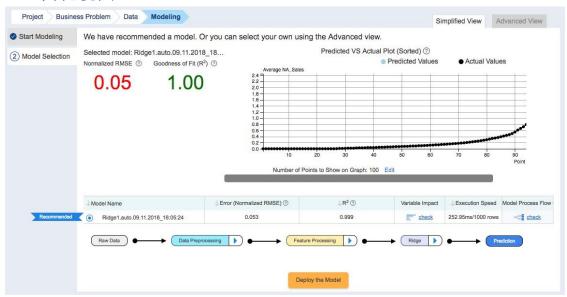


上图显示以下图表:

- 1. **误差/混淆矩阵:** 此矩阵将预测值与真实值进行比较。是一个显示了真阳性 (TP),假阳性 (FP),真阴性 (TN)和假阴性 (FN)的数量的矩阵。
- 2. **ROC 曲线 (可调整)**: 随着阈值的调整,二分类模型的分类能力。单击滑块可调整阈值。
- 3. 预测分布(可调整):这张图里是概率密度分布,概率阈值可调。
- 4. **精确找回曲线(可调整)**: 这张图是召回率和精确度的关系图。单击滑块可调整。
- 5. **提升曲线:** 提升曲线图反映了使用模型和不使用模型获得的结果的提升。反映了模型的有效性。
- 模型流程图: 这张图显示了模型时如何逐步构建的。
- 7. **变量影响**:模型中的每个变量对预测目标的的实际影响。值越高,表示对模型 预测的影响越大。

附录 D: 回归问题的模型选择

D.1. 简化视图



在回归问题中的模型选择中,会显示以下内容:

- **所选模型**: 您当前选择的机器学习模型。这是从下面显示的经过训练的机器 学习模型列表中选择的。
- **归一化 RMSE(均方根误差)**: 可帮助您比较模型的性能。其值越小,模型预测的数据越好。
- **拟合质量(R²)**:R²是一个表示回归线与给定数据拟合程度的度量指标。R²值越高,模型越接近数据。
 - **变量影响**: 是模型中每个变量对预测目标变量的影响。值越高,变量的 变化对模型预测结果的影响越大。
- **预测 v.s.实际(排序):** 显示模型预测值与实际值的接近程度。您可单击图表下的"编辑"更改显示的数据点。
- **训练模型列表**: 此处还显示了使用训练数据构建的模型列表。列出的模型各有一个:
 - 模型名称:此模型的名字。通常为 "<algorithm_name>.<model_setting_name>"。若您选择自动建模时, <model_setting_name>会自动为您创建。若您选择了高级建模, 您可自行设定名称。

- **误差(归一化 RMSE)**:RMSE(均方根误差)是模型标准误差的平方根,显示了模型预测值与实际目标变量值的接近程度。
- **执行速度**:每处理 1000 行数据,模型需要花费的时间。
- **变量影响**:单击**查看**,可查看每个模型变量对目标变量的影响。 该值 越高,说明该变量的变化对模型预测的结果的影响越大。
- **模型流程**: 单击**查看**,可看到此模型构建的每一步流程和详细处理方法。

D.2. 高级视图



用户可以使用高级视图查看有关可用于部署的模型的更多详细信息。

D.2.1. 顶部

顶部显示以下内容:

• 模型名字: 您可根据算法和模型设置筛选, 快速找到模型。

D.2.2. 模型表

下表显示了使用数据集训练的所有模型。每个列出的模型都有:

- **模型名字:** 此模型的名字。通常为 "<algorithm_name>.<model_setting_name>"。若您选择自动建模时, <model_setting_name>会自动为您创建。若您选择了高级建模,您可自行设定 名称。
- RMSE (均方根误差): RMSE 是 MSE 的平方根,通常用于比较不同模型之间的预测误差。
- RMLSE (均方根对数平方误差): RMLSE 是 MSE 对数值的平方根。
- MSE (均方误差): MSE 是模型预测值与实际值之间误差平方的平均值。
- MAE (平均绝对误差):模型预测值与实际值之差的绝对值的平均数。
- **R**²: R² 是一个表示回归线与给定数据拟合程度的度量指标。R² 值越高,模型越接近数据。、
- R² 调整: 调整后 R²是 R²的调整版,它对模型中的预测变量数进行了调整。它总是低于 R²。

- 变量列表:显示训练数据集中的哪些变量包含在模型中。
- **验证/交叉验证**:验证/交叉验证数据集是用于微调初始模型,可查看变量之间的关系是否正确操作,以创建可能的最佳模型的数据。
- **留出:** 留出集是为模型的最终测试留出的一部分原始数据,用于评估模型的 执行情况。

D.2.3. 其它模型细节

要查看其他模型详细信息,请单击模型名称旁边的+。



上图显示以下图表:

- 1. **拟合图:** 拟合图显示了模型的预测精度。横轴为目标变量的实际值,纵轴为目标变量的预测值。45 度线(y=x)表明所有的目标变量都被准确的预测了。图中接近或在45 度线上的点越多,表示模型的预测性能越好。
- 2. **残差图:** 残差是给定数据点目标变量的实际值和预测值之间的差值。横轴是残差,纵轴是实际目标变量值。观察残差图可发现当模型应用于给定数据集时可能会出现的问题。点击**诊断**可将当前模型的残差图与数种常见的残差图进行比较,给您提供如何改进模型的思路。当您在打开的对话框种选中最接近模型残差图的残差图形状后,R2-Learn 会给出修复方法:
 - 随机分布的残差图
 - Y轴不平衡的残差图
 - X 轴不平衡的残差图
 - 异常值残差图
 - 非线性残差图
 - 异方差残差图
 - 大Y轴数据点残差图

- 3. 模型流程图: 这张图显示了模型时如何逐步构建的。
- 4. **变量影响**:模型中的每个变量对预测目标的的实际影响。值越高,表示对模型 预测的影响越大。