



Politechnika Wrocławska

Pakiety statystyczne – las losowy

Wydział Matematyki Politechniki Wrocławskiej

Łukasz Łaszczuk

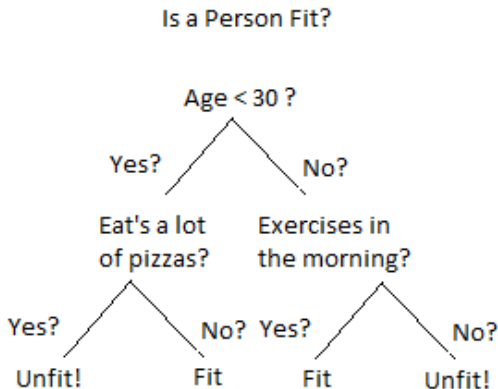
Plan prezentacji

- Opis algorytmu
 - Co to są drzewa decyzyjne?
 - Drzewa decyzyjne w problemach klasyfikacyjnych i regresyjnych
 - W jaki sposób drzewa decyzyjne są wykorzystywane podczas tworzenia lasu losowego
- Modelowanie za pomocą lasu losowego
 - Eksploracyjna analiza danych
 - Omówienie metryk do ewaluacji
 - Budowa modelu, dobór hiperparametrów
 - Porównanie z innymi modelami

Drzewa decyzyjne

- ❖ Drzewa decyzyjne same w sobie nie są skutecznym algorytmem, ale stanowią podstawę efektywnych modeli ensemble, np. lasów losowych, czy gradient boostingu;
- ❖ Intuicja: zbiór pytań (reguł eksperckich) oddzielających od siebie grupy (np. dobrych i złych klientów banku);
- ❖ Jest algorytmem glass-box (w łatwy sposób możemy zrozumieć jego działanie oraz istotne zmienne - im wcześniej pojawi się w drzewie, tym jest istotniejsza).

Drzewa decyzyjne

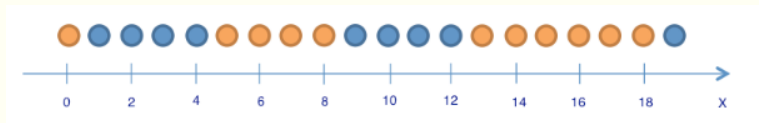


<https://www.xoriant.com/blog/product-engineering/decision-trees-machine-learning-algorithm.html>

Przydatne pojęcia - entropia Shannona

Intuicja: miara "chaosu" naszego zbioru.

Entropia Shannona: $S = - \sum_{i=1}^N p_i \log_2 p_i$



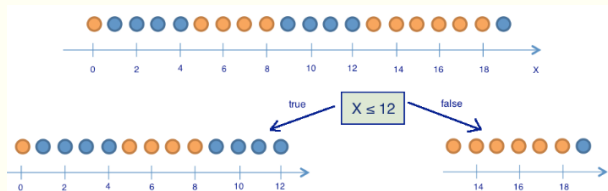
$$S = -\frac{9}{20} \log_2 \frac{9}{20} - \frac{11}{20} \log_2 \frac{11}{20} \approx 1$$

<https://mlcourse.ai/articles/topic3-dt-knn/>

Przydatne pojęcia - przyrost informacji

Intuicja: miara zmniejszenia "chaosu" po dokonaniu podziału danych (stworzenia rozgałęzienia). Chcemy ją maksymalizować przy kolejnych podziałach.

Przyrost informacji (Information Gain): $IG = S_0 - \sum_{i=1}^q \frac{N_i}{N} S_i$



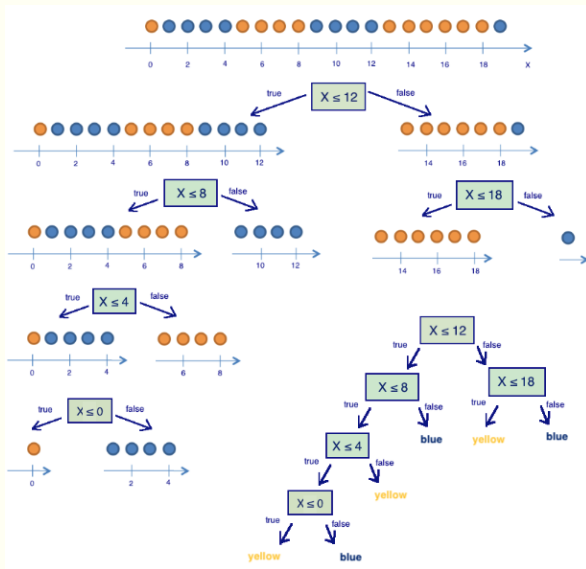
$$IG = S_0 - \frac{13}{20} S_1 - \frac{7}{20} S_2 \approx 0,16$$

<https://mlcourse.ai/articles/topic3-dt-knn/>

Kroki algorytmu

1. Drzewo zaczyna od pojedynczego węzła reprezentującego cały zbiór treningowy;
2. Jeżeli wszystkie przykłady należą do jednej klasy decyzyjnej, to zbadany węzeł staje się liściem i jest on etykietowany tą decyzją;
3. W przeciwnym przypadku algorytm wykorzystuje miarę entropii (funkcja przyrostu informacji) jako heurystyki do wyboru atrybutu, który najlepiej dzieli zbiór przykładów treningowych;
4. Dla każdego wyniku testu tworzy się jedno odgałęzienie i przykłady treningowe są odpowiednio rozdzielone do nowych węzłów (poddrzew);
5. Algorytm działa dalej w rekurencyjny sposób dla zbiorów przykładów przydzielonych do poddrzew.;
6. Algorytm kończy się, gdy kryterium stopu jest spełnione.

Cały algorytm - wizualizacja



Drzewa decyzyjne - regresja

W problemie regresji sposób tworzenia drzew pozostaje taki sam, zmienia się jednak kryterium podziału (na wariancję):

$$D = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \left(y_i - \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n y_j \right)^2$$

Końcową predykcją jest średnia zmiennej objaśnianej w danym liście.

- ❖ Drzewa decyzyjne w łatwy sposób jest przeuczyć (nie potrafią generalizować swoich predykcji na zbiorze testowym) - duża wariancja;
- ❖ Można częściowo temu zapobiec poprzez wcześniejsze zatrzymanie algorytmu (ustawienie maksymalnej głębokości lub minimalnej ilości obserwacji, która musi znaleźć się w liściu)

Twierdzenie Condorceta

- ❖ Cel: podjęcie decyzji (tak lub nie);
- ❖ Głosuje N jurorów, końcowa decyzja zapada większością głosów;
- ❖ Jurorzy głosują niezależnie od siebie, każdy z nich podejmuje właściwą decyzję z prawdopodobieństwem p ;
- ❖ Prawdopodobieństwo podjęcia właściwej decyzji

końcowej:
$$\mu = \sum_{i=\frac{N}{2}+1}^N \binom{N}{i} p^i (1-p)^{N-i}$$

- ❖ Jeśli $p > 0,5$, to przy $N \rightarrow \infty$, $\mu \rightarrow 1$

Las losowy

Intuicja: Zbudowanie wielu "słabych" modeli (drzew), które po połączeniu (w przypadku lasu losowego po wyciągnięciu średniej) dadzą lepszy wynik niż pojedynczy model.

Problem: Sprawienie, aby decyzje kolejnych drzew były niezależne oraz jak najdokładniejsze;

Lasy losowe - algorytm

- ❖ Z próby o wielkości N (nasze dane) losujemy jednostajnie ze zwracaniem N elementów, tworząc nową próbę (bootstrapping);
- ❖ Ze zbioru stworzoną metodą bootstrap, wybieramy losowo m spośród p zmiennych (kolumn; przyjmuje się domyślną wartość m jako $\lfloor \sqrt{p} \rfloor$ (klasyfikacja) lub $\lfloor \frac{p}{3} \rfloor$ (regresja));
- ❖ Na próbie tej budujemy nasz podstawowy model (drzewo decyzyjne - model, który jest przetrenowany);
- ❖ Powtarzamy poprzednie kroki B razy;
- ❖ Tworzymy końcowy model metodą głosowania większościowego (majority voting - klasyfikacja), bądź wyciągamy średnią (regresja) - dostajemy model lepszy niż drzewo decyzyjne (bagging).

Obserwacje OOB (out of bag)

- ❖ Obserwacje OOB – obserwacje, które nie znalazły się w zbiorze, na którym budowaliśmy drzewo decyzyjne;
- ❖ Prawdopodobieństwo zdarzenia, że losowo wybrana obserwacja z próby o wielkości l nie znajdzie się w zbiorze bootstrap: $(1 - \frac{1}{l})^l$;
- ❖ Gdy $l \rightarrow \infty$, prawdopodobieństwo to wynosi $\frac{1}{e} \approx 37\%$;
- ❖ Obserwacje OOB stanowią reprezentatywną próbę zbioru, możemy na nich testować nasz model (alternatywa do walidacji krzyżowej, ang. cross-validation).

Zalety lasów losowych

- ❖ Jest skuteczniejszy od algorytmów liniowych oraz drzew decyzyjnych;
- ❖ Odporny na wartości odstające (dzięki baggingowi) oraz na wartości None;
- ❖ Działa skutecznie bez optymalizacji hiperparametrów (dzięki temu mamy dobry punkt odnosienia przy budowaniu innych modeli, np. xgboosta);
- ❖ Obserwacjom z różnych klas możemy przypisywać wagi (szczególnie przydatne przy niezbalansowanych zbiorach danych);
- ❖ Jest algorytmem, który się nie przeucza.

Wady lasów losowych

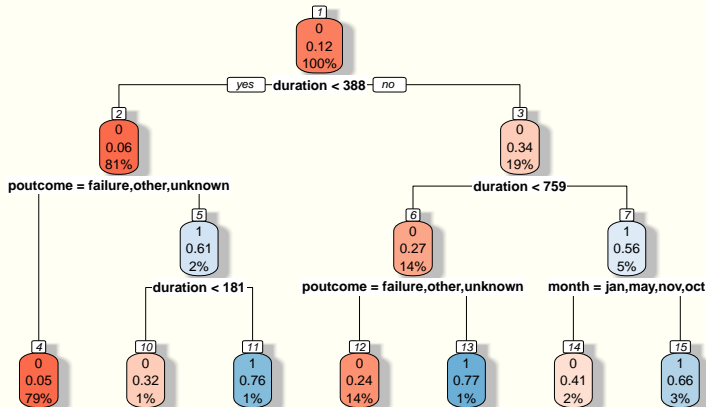
- ❖ Trudniejszy w interpretacji niż drzewo decyzyjne (istnieją jednak metody wyjaśniania);
- ❖ Nie radzi sobie z danymi, które są rzadkie (np. zastosowanie one hot encodingu zmiennych kategorycznych może pogorszyć rezultaty) oraz które mają bardzo dużą ilość zmiennych;
- ❖ W przeciwieństwie do modeli liniowych ekstrapolacja nie jest możliwa;
- ❖ Modele lasów losowych potrzebują więcej pamięci niż modele xgboost (ponieważ trenują głębsze drzewa decyzyjne).

Przedstawienie danych

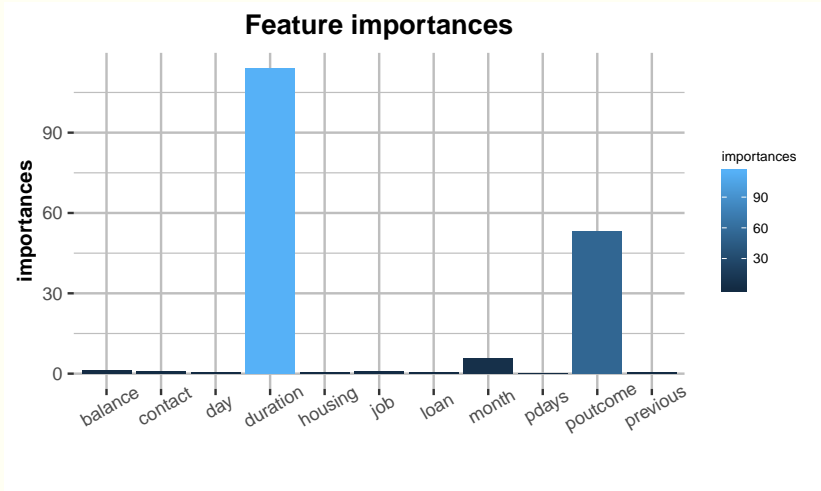
- ❖ Bank Marketing Data Set;
- ❖ 17 kolumn (9 kategoriowych, 7 numerycznych oraz binarna zmienna objaśniana)
- ❖ 4521 obserwacji;
- ❖ Zmienna objaśniana (y) zawiera informację, czy klient skorzystał z oferty banku (lokaty terminowej).

Pierwszy model - drzewo decyzyjne

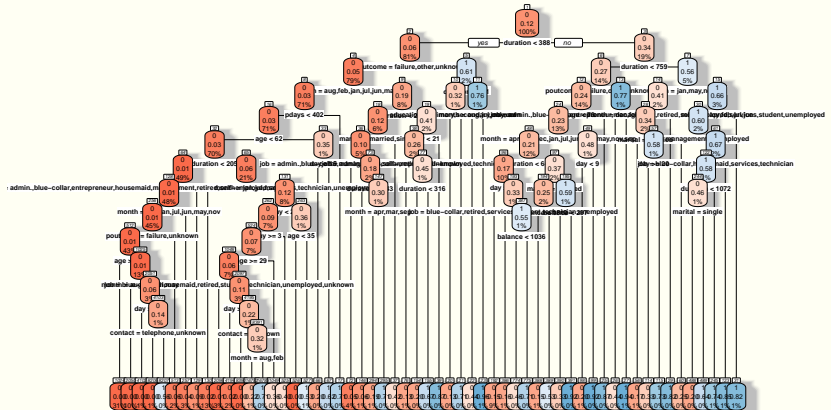
```
tree <- rpart(y ~ ., data = df_train, cp = 0.02)
rpart.plot(tree, box.palette = "RdBu",
            shadow.col = "gray", nn = TRUE)
```

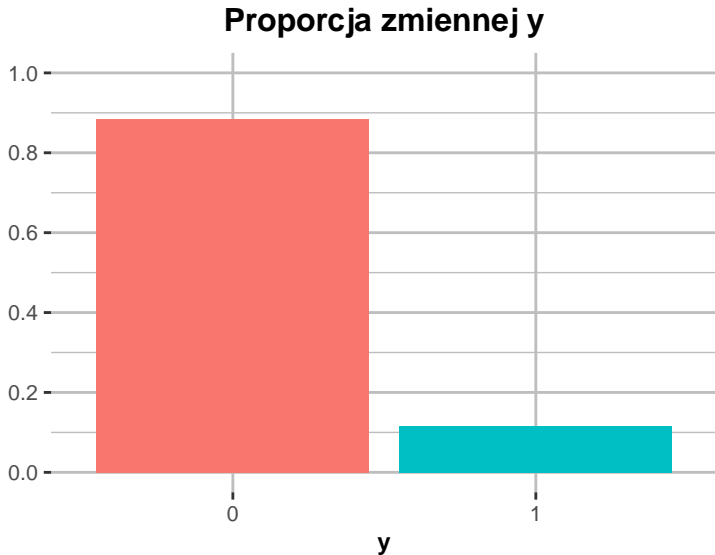


Pierwszy model - drzewo decyzyjne

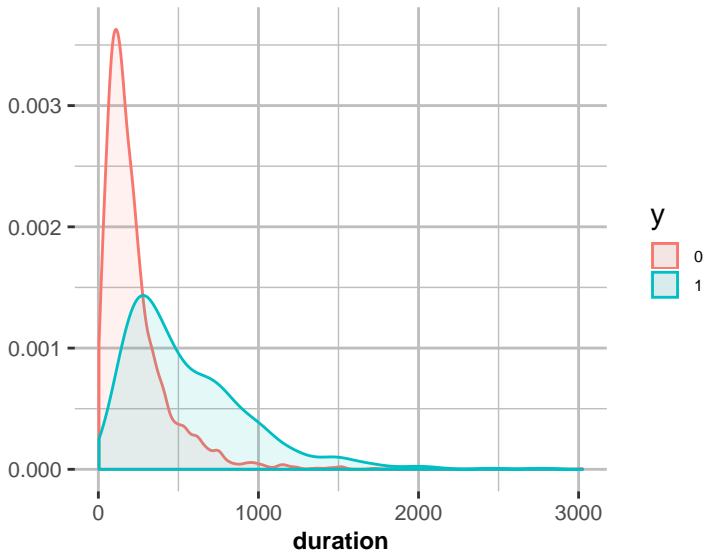


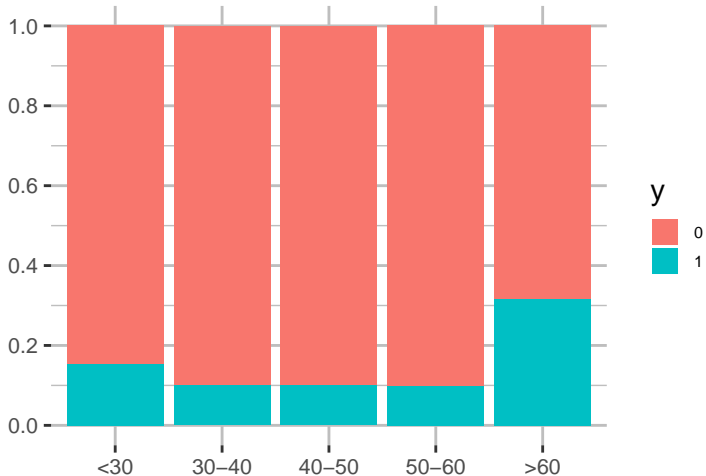
Pierwszy model - drzewo decyzyjne

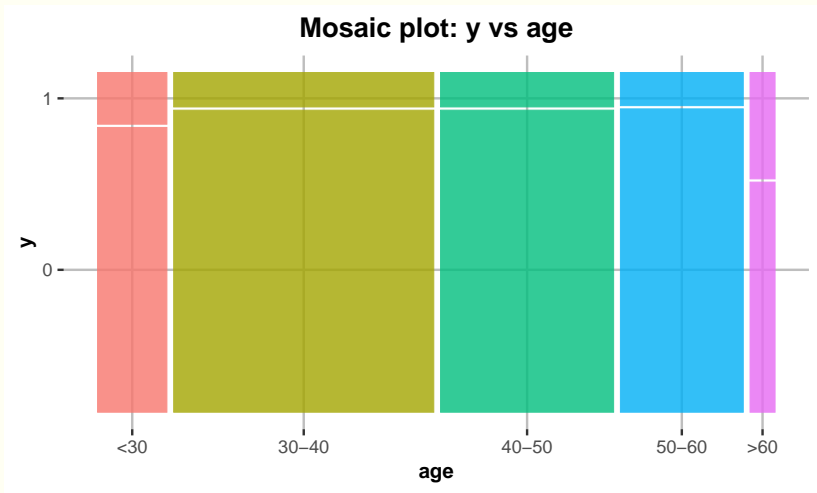


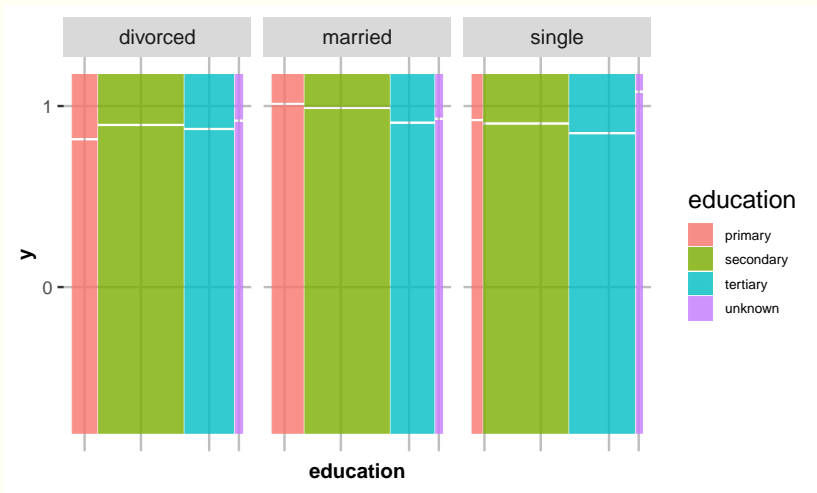


EDA

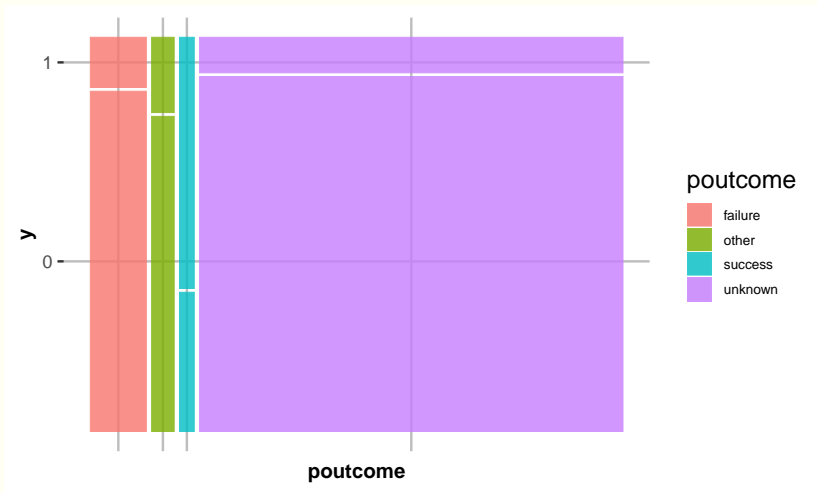


Proporcja subskrybcji vs wiek





EDA



Metryki do ewaluacji modeli

- ❖ Niezbalansowany zbiór danych (około 10% to obserwacje pozytywne);
- ❖ Dokładność (accuracy) nie jest odpowiednią metryką - przewidując same 0 osiągniemy 90% dokładności;
- ❖ Nasza metryka: miara F1 (F1 score)

$$F_1 = 2 \cdot \frac{\textit{precision} \cdot \textit{recall}}{\textit{precision} + \textit{recall}}$$