

Введение в искусственный интеллект. Машинное обучение

Тема: Бустинг

Иванов И.Е.

кафедра Математической Теории Интеллектуальных Систем



① AdaBoost

- 1 AdaBoost
- 2 AnyBoost

- 1 AdaBoost
- 2 AnyBoost
- 3 GB / SGB

- 1 AdaBoost
- 2 AnyBoost
- 3 GB / SGB
- 4 TreeBoost

Обозначим взвешенную сумму выходов базовых классификаторов $b_t(x)$ как $a(x) = \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t, \alpha_t \in \mathbb{R}$.



Обозначим взвешенную сумму выходов базовых классификаторов $b_t(x)$ как $a(x) = \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t, \alpha_t \in \mathbb{R}$.

AdaBoost

- Базовые алгоритмы $b_t(x)$ принимают значения из дискретного множества (например, $\{-1, +1\}$),
- Функция потерь: $e^{-y_i a(x_i)}$



Обозначим взвешенную сумму выходов базовых классификаторов $b_t(x)$ как $a(x) = \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t$, $\alpha_t \in \mathbb{R}$.

AdaBoost

- Базовые алгоритмы $b_t(x)$ принимают значения из дискретного множества (например, $\{-1, +1\}$),
- Функция потерь: $e^{-y_i a(x_i)}$

AnyBoost

- Базовые алгоритмы $b_t(x)$ принимают значения из \mathbb{R} ,
- Функция потерь $L : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ – гладкая функция от $y_i a(x_i)$



Обозначим взвешенную сумму выходов базовых классификаторов $b_t(x)$ как $a(x) = \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t, \alpha_t \in \mathbb{R}$.

AdaBoost

- Базовые алгоритмы $b_t(x)$ принимают значения из дискретного множества (например, $\{-1, +1\}$),
- Функция потерь: $e^{-y_i a(x_i)}$

AnyBoost

- Базовые алгоритмы $b_t(x)$ принимают значения из \mathbb{R} ,
- Функция потерь $L : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ – гладкая функция от $y_i a(x_i)$

Gradient Boosting

- Базовые алгоритмы $b_t(x)$ принимают значения из \mathbb{R} ,
- Функция потерь $L : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ – гладкая функция от пары $(y_i, a(x_i))$



- Базовый алгоритм $b_t : X \rightarrow \{-1, +1\}$

Обозначения для AdaBoost

- Базовый алгоритм $b_t : X \rightarrow \{-1, +1\}$
- Вектор весов (взвешиваем объекты) $W^m = (w_1, \dots, w_m)$: $w_i = e^{-y_i \sum_{t=1}^{T-1} \alpha_t b_t(x_i)}$



Обозначения для AdaBoost

- Базовый алгоритм $b_t : X \rightarrow \{-1, +1\}$
- Вектор весов (взвешиваем объекты) $W^m = (w_1, \dots, w_m)$: $w_i = e^{-y_i \sum_{t=1}^{T-1} \alpha_t b_t(x_i)}$
- Нормировка: $\tilde{w}_i = \frac{w_i}{\sum_{j=1}^m w_j} \Rightarrow \sum_{i=1}^m \tilde{w}_i = 1, 0 \leq \tilde{w}_i \leq 1$



Обозначения для AdaBoost

- Базовый алгоритм $b_t : X \rightarrow \{-1, +1\}$
- Вектор весов (взвешиваем объекты) $W^m = (w_1, \dots, w_m)$: $w_i = e^{-y_i \sum_{t=1}^{T-1} \alpha_t b_t(x_i)}$
- Нормировка: $\tilde{w}_i = \frac{w_i}{\sum_{j=1}^m w_j} \Rightarrow \sum_{i=1}^m \tilde{w}_i = 1, 0 \leq \tilde{w}_i \leq 1$
- Вероятностный вектор $U^m = (u_1, \dots, u_m)$: $\sum_{i=1}^m u_i = 1, u_i \geq 0$,



Обозначения для AdaBoost

- Базовый алгоритм $b_t : X \rightarrow \{-1, +1\}$
- Вектор весов (взвешиваем объекты) $W^m = (w_1, \dots, w_m)$: $w_i = e^{-y_i \sum_{t=1}^{T-1} \alpha_t b_t(x_i)}$
- Нормировка: $\tilde{w}_i = \frac{w_i}{\sum_{j=1}^m w_j} \Rightarrow \sum_{i=1}^m \tilde{w}_i = 1, 0 \leq \tilde{w}_i \leq 1$
- Вероятностный вектор $U^m = (u_1, \dots, u_m)$: $\sum_{i=1}^m u_i = 1, u_i \geq 0$,
- Взвешенное число правильных классификаций алгоритма $b(x)$ по вектору U^m :
 $P(b; U^m) = \sum_{i=1}^m u_i [b(x) = y_i]$
- Взвешенное число ошибочных классификаций алгоритма $b(x)$ по вектору U^m :
 $N(b; U^m) = \sum_{i=1}^m u_i [b(x) \neq y_i]$



Обозначения для AdaBoost

- Базовый алгоритм $b_t : X \rightarrow \{-1, +1\}$
- Вектор весов (взвешиваем объекты) $W^m = (w_1, \dots, w_m)$: $w_i = e^{-y_i \sum_{t=1}^{T-1} \alpha_t b_t(x_i)}$
- Нормировка: $\tilde{w}_i = \frac{w_i}{\sum_{j=1}^m w_j} \Rightarrow \sum_{i=1}^m \tilde{w}_i = 1, 0 \leq \tilde{w}_i \leq 1$
- Вероятностный вектор $U^m = (u_1, \dots, u_m)$: $\sum_{i=1}^m u_i = 1, u_i \geq 0$,
- Взвешенное число правильных классификаций алгоритма $b(x)$ по вектору U^m :
 $P(b; U^m) = \sum_{i=1}^m u_i [b(x) = y_i]$
- Взвешенное число ошибочных классификаций алгоритма $b(x)$ по вектору U^m :
 $N(b; U^m) = \sum_{i=1}^m u_i [b(x) \neq y_i]$
- $P + N = 1$.



Пусть A – достаточно богатое семейство базовых алгоритмов.

Теорема

Если для любого нормированного вектора U^m существует алгоритм $b \in A$, т.ч. $N(b; U^m) < \frac{1}{2}$, то минимум аппроксимированного Э.Р. \tilde{R}_T достигается на:



Пусть A – достаточно богатое семейство базовых алгоритмов.

Теорема

Если для любого нормированного вектора U^m существует алгоритм $b \in A$, т.ч. $N(b; U^m) < \frac{1}{2}$, то минимум аппроксимированного Э.Р. \tilde{R}_T достигается на:

- $b_T = \arg \min_{b \in A} N(b; \tilde{W}^m)$



Пусть A – достаточно богатое семейство базовых алгоритмов.

Теорема

Если для любого нормированного вектора U^m существует алгоритм $b \in A$, т.ч. $N(b; U^m) < \frac{1}{2}$, то минимум аппроксимированного Э.Р. \tilde{R}_T достигается на:

- $b_T = \arg \min_{b \in A} N(b; \tilde{W}^m)$
- $\alpha_T = \frac{1}{2} \ln \frac{1 - N(b; \tilde{W}^m)}{N(b; \tilde{W}^m)}$



Алгоритм AdaBoost¹

Алгоритм

- Инициализация весов: $w_i = \frac{1}{m}, i = 1, \dots, m,$

¹Freund Y. and Schapire R.E (1997). "A decision-theoretic generalization of on-line learning and an application to boosting"

Алгоритм AdaBoost¹

Алгоритм

- Инициализация весов: $w_i = \frac{1}{m}, i = 1, \dots, m,$

Для $t = 1, \dots, T$

- Обучение базового алгоритма $b_t = \arg \min_{b \in A} N(b; \widetilde{W}^m),$

¹Freund Y. and Schapire R.E (1997). "A decision-theoretic generalization of on-line learning and an application to boosting"

Алгоритм AdaBoost¹

Алгоритм

- Инициализация весов: $w_i = \frac{1}{m}, i = 1, \dots, m,$

Для $t = 1, \dots, T$

- Обучение базового алгоритма $b_t = \arg \min_{b \in A} N(b; \widetilde{W}^m),$
- Вычисление нового веса $\alpha_t = \frac{1}{2} \ln \frac{1 - N(b_t; \widetilde{W}^m)}{N(b_t; \widetilde{W}^m)},$

¹Freund Y. and Schapire R.E (1997). "A decision-theoretic generalization of on-line learning and an application to boosting"

Алгоритм AdaBoost¹

Алгоритм

- Инициализация весов: $w_i = \frac{1}{m}, i = 1, \dots, m,$

Для $t = 1, \dots, T$

- Обучение базового алгоритма $b_t = \arg \min_{b \in A} N(b; \widetilde{W}^m),$
- Вычисление нового веса $\alpha_t = \frac{1}{2} \ln \frac{1 - N(b_t; \widetilde{W}^m)}{N(b_t; \widetilde{W}^m)},$
- Обновление весов $w_i := w_i e^{-\alpha_t y_i b_t(x_i)}, i = 1, \dots, m,$

¹Freund Y. and Schapire R.E (1997). "A decision-theoretic generalization of on-line learning and an application to boosting"

Алгоритм AdaBoost¹

Алгоритм

- Инициализация весов: $w_i = \frac{1}{m}, i = 1, \dots, m,$

Для $t = 1, \dots, T$

- Обучение базового алгоритма $b_t = \arg \min_{b \in A} N(b; \widetilde{W}^m),$
- Вычисление нового веса $\alpha_t = \frac{1}{2} \ln \frac{1 - N(b_t; \widetilde{W}^m)}{N(b_t; \widetilde{W}^m)},$
- Обновление весов $w_i := w_i e^{-\alpha_t y_i b_t(x_i)}, i = 1, \dots, m,$
- Перенормировка весов $w_i := \frac{w_i}{\sum_{j=1}^m w_j}, i = 1, \dots, m.$

¹Freund Y. and Schapire R.E (1997). "A decision-theoretic generalization of on-line learning and an application to boosting"

Замечание относительно шага обновления весов $w_i := w_i e^{-\alpha_t y_i b_t(x_i)}$, $i = 1, \dots, m$.

Замечание относительно шага обновления весов $w_i := w_i e^{-\alpha_t y_i b_t(x_i)}$, $i = 1, \dots, m$.

- b_t ошибается на объекте $x_i \Rightarrow y_i \neq b_t(x_i) \Rightarrow y_i b_t(x_i) = -1$



Замечание относительно шага обновления весов $w_i := w_i e^{-\alpha_t y_i b_t(x_i)}$, $i = 1, \dots, m$.

- b_t ошибается на объекте $x_i \Rightarrow y_i \neq b_t(x_i) \Rightarrow y_i b_t(x_i) = -1$
- b_t правильно классифицирует объект $x_i \Rightarrow y_i = b_t(x_i) \Rightarrow y_i b_t(x_i) = +1$



Замечание относительно шага обновления весов $w_i := w_i e^{-\alpha_t y_i b_t(x_i)}$, $i = 1, \dots, m$.

- b_t ошибается на объекте $x_i \Rightarrow y_i \neq b_t(x_i) \Rightarrow y_i b_t(x_i) = -1$
- b_t правильно классифицирует объект $x_i \Rightarrow y_i = b_t(x_i) \Rightarrow y_i b_t(x_i) = +1$

- Поскольку $N(b; U^m) < \frac{1}{2}$ для любого нормированного U^m , то

$$\alpha_t = \frac{1}{2} \ln \frac{1 - N(b_t; \widetilde{W}^m)}{N(b_t; \widetilde{W}^m)} > \frac{1}{2} \ln \frac{1}{2} = \frac{1}{2} \ln 1 = 0$$



Замечание относительно шага обновления весов $w_i := w_i e^{-\alpha_t y_i b_t(x_i)}$, $i = 1, \dots, m$.

- b_t ошибается на объекте $x_i \Rightarrow y_i \neq b_t(x_i) \Rightarrow y_i b_t(x_i) = -1$
- b_t правильно классифицирует объект $x_i \Rightarrow y_i = b_t(x_i) \Rightarrow y_i b_t(x_i) = +1$
- Поскольку $N(b; U^m) < \frac{1}{2}$ для любого нормированного U^m , то
$$\alpha_t = \frac{1}{2} \ln \frac{1 - N(b_t; \widetilde{W}^m)}{N(b_t; \widetilde{W}^m)} > \frac{1}{2} \ln \frac{1}{\frac{1}{2}} = \frac{1}{2} \ln 2 > 0$$
- Вес объекта x_i увеличивается в e^{α_t} раз, когда b_t допускает на нем ошибку,



Замечание относительно шага обновления весов $w_i := w_i e^{-\alpha_t y_i b_t(x_i)}$, $i = 1, \dots, m$.

- b_t ошибается на объекте $x_i \Rightarrow y_i \neq b_t(x_i) \Rightarrow y_i b_t(x_i) = -1$
- b_t правильно классифицирует объект $x_i \Rightarrow y_i = b_t(x_i) \Rightarrow y_i b_t(x_i) = +1$
- Поскольку $N(b; U^m) < \frac{1}{2}$ для любого нормированного U^m , то
$$\alpha_t = \frac{1}{2} \ln \frac{1 - N(b_t; \widetilde{W}^m)}{N(b_t; \widetilde{W}^m)} > \frac{1}{2} \ln \frac{\frac{1}{2}}{\frac{1}{2}} = \frac{1}{2} \ln 1 = 0$$
- Вес объекта x_i увеличивается в e^{α_t} раз, когда b_t допускает на нем ошибку,
- Вес объекта x_i уменьшается в e^{α_t} раз, когда b_t правильно его классифицирует,



Замечание относительно шага обновления весов $w_i := w_i e^{-\alpha_t y_i b_t(x_i)}$, $i = 1, \dots, m$.

- b_t ошибается на объекте $x_i \Rightarrow y_i \neq b_t(x_i) \Rightarrow y_i b_t(x_i) = -1$
- b_t правильно классифицирует объект $x_i \Rightarrow y_i = b_t(x_i) \Rightarrow y_i b_t(x_i) = +1$
- Поскольку $N(b; U^m) < \frac{1}{2}$ для любого нормированного U^m , то
$$\alpha_t = \frac{1}{2} \ln \frac{1 - N(b_t; \widetilde{W}^m)}{N(b_t; \widetilde{W}^m)} > \frac{1}{2} \ln \frac{1}{2} = \frac{1}{2} \ln 1 = 0$$
- Вес объекта x_i увеличивается в e^{α_t} раз, когда b_t допускает на нем ошибку,
- Вес объекта x_i уменьшается в e^{α_t} раз, когда b_t правильно его классифицирует,
- Т.о. наибольший вес будет у тех объектов, которые чаще неправильно классифицировались предыдущими алгоритмами (т.е. классификатору прежде всего нужно сосредоточиться именно на них!).



- После построения некоторого количества базовых алгоритмов (например, $T = 10 \dots 30$) можно проанализировать распределение весов объектов:



- После построения некоторого количества базовых алгоритмов (например, $T = 10 \dots 30$) можно проанализировать распределение весов объектов:
 - Объекты с максимальными весами \tilde{w}_i , скорее всего, являются шумовыми выбросами



- После построения некоторого количества базовых алгоритмов (например, $T = 10 \dots 30$) можно проанализировать распределение весов объектов:
 - Объекты с максимальными весами \tilde{w}_i , скорее всего, являются шумовыми выбросами
 - Их нужно исключить из выборки



- После построения некоторого количества базовых алгоритмов (например, $T = 10 \dots 30$) можно проанализировать распределение весов объектов:
 - Объекты с максимальными весами \tilde{w}_i , скорее всего, являются шумовыми выбросами
 - Их нужно исключить из выборки
 - После чего начать построение композиции заново



- После построения некоторого количества базовых алгоритмов (например, $T = 10 \dots 30$) можно проанализировать распределение весов объектов:
 - Объекты с максимальными весами \tilde{w}_i , скорее всего, являются шумовыми выбросами
 - Их нужно исключить из выборки
 - После чего начать построение композиции заново
- Бустинг можно использовать как универсальный метод фильтрации выбросов перед применением любого другого метода классификации



Обобщающая способность бустинга: эмпирические замечания

- Во многих экспериментах тестовая ошибка практически постоянно уменьшалась по мере увеличения числа алгоритмов в композиции



Обобщающая способность бустинга: эмпирические замечания

- Во многих экспериментах тестовая ошибка практически постоянно уменьшалась по мере увеличения числа алгоритмов в композиции
 - Часто тестовая ошибка уменьшалась даже после достижения нулевой ошибки на обучающей выборке!



Обобщающая способность бустинга: эмпирические замечания

- Во многих экспериментах тестовая ошибка практически постоянно уменьшалась по мере увеличения числа алгоритмов в композиции
 - Часто тестовая ошибка уменьшалась даже после достижения нулевой ошибки на обучающей выборке!
- *Теоретическое обоснование “на пальцах”*:
взвешенное голосование не увеличивает эффективную сложность алгоритма (т.о. не переобучаемся), а сглаживает ответы базовых алгоритмов

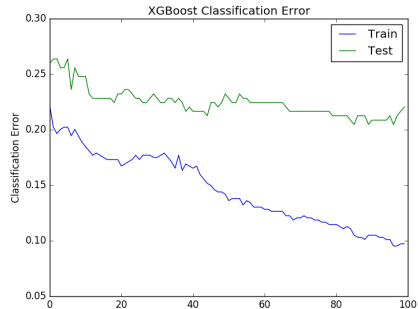
Обобщающая способность бустинга: эмпирические замечания

- Во многих экспериментах тестовая ошибка практически постоянно уменьшалась по мере увеличения числа алгоритмов в композиции
 - Часто тестовая ошибка уменьшалась даже после достижения нулевой ошибки на обучающей выборке!
- *Теоретическое обоснование “на пальцах”*:
взвешенное голосование не увеличивает эффективную сложность алгоритма (т.о. не переобучаемся), а сглаживает ответы базовых алгоритмов
 - Т.к. стараемся увеличить величины
$$y_i \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x_i)$$




Обобщающая способность бустинга: эмпирические замечания

- Во многих экспериментах тестовая ошибка практически постоянно уменьшалась по мере увеличения числа алгоритмов в композиции
 - Часто тестовая ошибка уменьшалась даже после достижения нулевой ошибки на обучающей выборке!
- *Теоретическое обоснование “на пальцах”*: взвешенное голосование не увеличивает эффективную сложность алгоритма (т.о. не переобучаемся), а сглаживает ответы базовых алгоритмов
 - Т.к. стараемся увеличить величины $y_i \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x_i)$
 - Тем не менее, бустинг не идеален: иногда получается его переобучить




Обобщающая способность бустинга: теория²

- Пусть семейство базовых алгоритмов A конечно: $|A| < \infty$,

²R. Schapire et al (1998). "Boosting the margin: A new explanation for the effectiveness of voting methods" 


Обобщающая способность бустинга: теория²

- Пусть семейство базовых алгоритмов A конечно: $|A| < \infty$,
- Ансамбль $a(x) = \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x)$ (без sign!),

²R. Schapire et al (1998). "Boosting the margin: A new explanation for the effectiveness of voting methods" 

Обобщающая способность бустинга: теория²

- Пусть семейство базовых алгоритмов A конечно: $|A| < \infty$,
- Ансамбль $a(x) = \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x)$ (без sign!),
- D – вероятностное распределение над $X \times \{-1, +1\}$,

²R. Schapire et al (1998). "Boosting the margin: A new explanation for the effectiveness of voting methods" 

Обобщающая способность бустинга: теория²

- Пусть семейство базовых алгоритмов A конечно: $|A| < \infty$,
- Ансамбль $a(x) = \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x)$ (без sign!),
- D – вероятностное распределение над $X \times \{-1, +1\}$,
- S – m независимых примеров из D (например, множество X^m). Тогда верна

²R. Schapire et al (1998). “Boosting the margin: A new explanation for the effectiveness of voting methods”

Обобщающая способность бустинга: теория²

- Пусть семейство базовых алгоритмов A конечно: $|A| < \infty$,
- Ансамбль $a(x) = \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x)$ (без sign!),
- D – вероятностное распределение над $X \times \{-1, +1\}$,
- S – m независимых примеров из D (например, множество X^m). Тогда верна

Теорема

Для $\forall \theta > 0$, $\forall 0 < \delta < 1$ с вероятностью $1 - \delta$ верно следующее:

$$P_D(ya(x) \leq 0) \leq P_S(ya(x) \leq \theta) + O\left(\sqrt{\frac{\ln m \ln |A|}{m\theta^2}} + \frac{1}{m} \ln \frac{1}{\delta}\right)$$

²R. Schapire et al (1998). "Boosting the margin: A new explanation for the effectiveness of voting methods"

Обобщающая способность бустинга: теория²

- Пусть семейство базовых алгоритмов A конечно: $|A| < \infty$,
- Ансамбль $a(x) = \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x)$ (без sign!),
- D – вероятностное распределение над $X \times \{-1, +1\}$,
- S – m независимых примеров из D (например, множество X^m). Тогда верна

Теорема

Для $\forall \theta > 0$, $\forall 0 < \delta < 1$ с вероятностью $1 - \delta$ верно следующее:

$$P_D(ya(x) \leq 0) \leq P_S(ya(x) \leq \theta) + O\left(\sqrt{\frac{\ln m \ln |A|}{m\theta^2}} + \frac{1}{m} \ln \frac{1}{\delta}\right)$$

Вывод. Верхняя оценка не зависит от T : с увеличением T растет значение $ya(x) \Rightarrow$ увеличивая θ , уменьшим верхнюю оценку и в итоге улучшим обобщающую способность.

²R. Schapire et al (1998). "Boosting the margin: A new explanation for the effectiveness of voting methods" 

- Что использовать в качестве базовых классификаторов:

- Что использовать в качестве базовых классификаторов:
 - Чаще всего используют решающие деревья



- Что использовать в качестве базовых классификаторов:
 - Чаще всего используют решающие деревья
 - Также используют совсем вырожденные случаи – т.н. “пни”: $b(x) = [f_j(x) \leq r_j]$, где $x = (f_1(x), \dots, f_n(x)) \in \mathbb{R}^n$



- Что использовать в качестве базовых классификаторов:
 - Чаще всего используют решающие деревья
 - Также используют совсем вырожденные случаи – т.н. “пни”: $b(x) = [f_j(x) \leq r_j]$, где $x = (f_1(x), \dots, f_n(x)) \in \mathbb{R}^n$
 - SVM используется редко (обучается достаточно долго, прироста большого не дает)



- Что использовать в качестве базовых классификаторов:
 - Чаще всего используют решающие деревья
 - Также используют совсем вырожденные случаи – т.н. “пни”: $b(x) = [f_j(x) \leq r_j]$, где $x = (f_1(x), \dots, f_n(x)) \in \mathbb{R}^n$
 - SVM используется редко (обучается достаточно долго, прироста большого не дает)
- Если вдруг при обучении получается нулевая ошибка ($N = 0$), то формула для выбора оптимального коэффициента приобретает вид $\alpha = \frac{1}{2} \ln \frac{1 - N + \frac{1}{m}}{N + \frac{1}{m}} = \frac{1}{2} \ln(m + 1)$



- Что использовать в качестве базовых классификаторов:
 - Чаще всего используют решающие деревья
 - Также используют совсем вырожденные случаи – т.н. “пни”: $b(x) = [f_j(x) \leq r_j]$, где $x = (f_1(x), \dots, f_n(x)) \in \mathbb{R}^n$
 - SVM используется редко (обучается достаточно долго, прироста большого не дает)
- Если вдруг при обучении получается нулевая ошибка ($N = 0$), то формула для выбора оптимального коэффициента приобретает вид $\alpha = \frac{1}{2} \ln \frac{1 - N + \frac{1}{m}}{N + \frac{1}{m}} = \frac{1}{2} \ln(m + 1)$
- Нужно периодически производить фильтрацию выбросов в обучающей выборке



Визуализация работы основных методов классификации

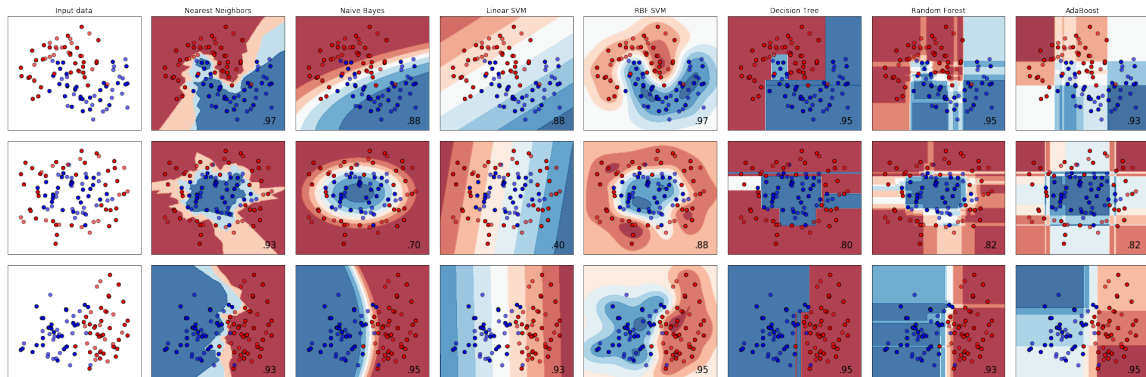
Посмотрим результаты работы основных классификаторов на трех разных задачах³.

³[https:](https://scikit-learn.org/stable/auto_examples/classification/plot_classifier_comparison.html)

[//scikit-learn.org/stable/auto_examples/classification/plot_classifier_comparison.html](https://scikit-learn.org/stable/auto_examples/classification/plot_classifier_comparison.html)

Визуализация работы основных методов классификации

Посмотрим результаты работы основных классификаторов на трех разных задачах³.



³[https:](https://scikit-learn.org/stable/auto_examples/classification/plot_classifier_comparison.html)

[//scikit-learn.org/stable/auto_examples/classification/plot_classifier_comparison.html](https://scikit-learn.org/stable/auto_examples/classification/plot_classifier_comparison.html)

Плюсы

- Хорошая обобщающая способность (сложно переобучить)

Плюсы

- Хорошая обобщающая способность (сложно переобучить)
- Простота реализации

Плюсы

- Хорошая обобщающая способность (сложно переобучить)
- Простота реализации
- Время обучения ансамбля (веса) на порядок меньше времени обучения базовых алгоритмов

Плюсы

- Хорошая обобщающая способность (сложно переобучить)
- Простота реализации
- Время обучения ансамбля (веса) на порядок меньше времени обучения базовых алгоритмов
- Можно фильтровать выбросы

Плюсы и минусы AdaBoost

Плюсы

- Хорошая обобщающая способность (сложно переобучить)
- Простота реализации
- Время обучения ансамбля (веса) на порядок меньше времени обучения базовых алгоритмов
- Можно фильтровать выбросы

Минусы

- Чувствителен к выбросам

Плюсы и минусы AdaBoost

Плюсы

- Хорошая обобщающая способность (сложно переобучить)
- Простота реализации
- Время обучения ансамбля (веса) на порядок меньше времени обучения базовых алгоритмов
- Можно фильтровать выбросы

Минусы

- Чувствителен к выбросам
- Композиция совершенно неинтерпретируема

Плюсы и минусы AdaBoost

Плюсы

- Хорошая обобщающая способность (сложно переобучить)
- Простота реализации
- Время обучения ансамбля (веса) на порядок меньше времени обучения базовых алгоритмов
- Можно фильтровать выбросы

Минусы

- Чувствителен к выбросам
- Композиция совершенно неинтерпретируема
- Базовые алгоритмы должны быть достаточно простыми, и их должно быть много (а лучше бы наоборот)



Плюсы и минусы AdaBoost

Плюсы

- Хорошая обобщающая способность (сложно переобучить)
- Простота реализации
- Время обучения ансамбля (веса) на порядок меньше времени обучения базовых алгоритмов
- Можно фильтровать выбросы

Минусы

- Чувствителен к выбросам
- Композиция совершенно неинтерпретируема
- Базовые алгоритмы должны быть достаточно простыми, и их должно быть много (а лучше бы наоборот)
- Необходимость в достаточно большой обучающей выборке (т.к. нет процедуры бутстрэпа)





Перейдём к более общему случаю:

⁴Mason, L., Baxter, J., Bartlett, P. L., and Frean, M. R. (2000). “Boosting algorithms as gradient descent”

Перейдём к более общему случаю:

- Недискретным ответам базовых алгоритмов, т.е. $b_t : X \rightarrow \mathbb{R}$

⁴Mason, L., Baxter, J., Bartlett, P. L., and Frean, M. R. (2000). “Boosting algorithms as gradient descent”

Перейдём к более общему случаю:

- Недискретным ответам базовых алгоритмов, т.е. $b_t : X \rightarrow \mathbb{R}$
- Функции потерь $L(h_T)$, гладкой от величины $h_T(x_i) = y_i \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x_i)$

⁴Mason, L., Baxter, J., Bartlett, P. L., and Frean, M. R. (2000). “Boosting algorithms as gradient descent”

Перейдём к более общему случаю:

- Недискретным ответам базовых алгоритмов, т.е. $b_t : X \rightarrow \mathbb{R}$
- Функции потерь $L(h_T)$, гладкой от величины $h_T(x_i) = y_i \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x_i)$

Принцип минимизации аппроксимированного Э.Р.:

$$R_T \leq \tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(h_{T-1}(x_i) + \alpha_T y_i b_T(x_i)) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}.$$

⁴Mason, L., Baxter, J., Bartlett, P. L., and Frean, M. R. (2000). “Boosting algorithms as gradient descent”

Перейдём к более общему случаю:

- Недискретным ответам базовых алгоритмов, т.е. $b_t : X \rightarrow \mathbb{R}$
- Функции потерь $L(h_T)$, гладкой от величины $h_T(x_i) = y_i \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x_i)$

Принцип минимизации аппроксимированного Э.Р.:

$$R_T \leq \tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(h_{T-1}(x_i) + \alpha_T y_i b_T(x_i)) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}.$$

Вспомним разложение Тейлора функции $f(x)$ в окрестности точки x_0 :

$$f(x) \approx f(x_0) + (x - x_0)f'(x_0).$$

⁴Mason, L., Baxter, J., Bartlett, P. L., and Frean, M. R. (2000). “Boosting algorithms as gradient descent”

Перейдём к более общему случаю:

- Недискретным ответам базовых алгоритмов, т.е. $b_t : X \rightarrow \mathbb{R}$
- Функции потерь $L(h_T)$, гладкой от величины $h_T(x_i) = y_i \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x_i)$

Принцип минимизации аппроксимированного Э.Р.:

$$R_T \leq \tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(h_{T-1}(x_i) + \alpha_T y_i b_T(x_i)) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}.$$

Вспомним разложение Тейлора функции $f(x)$ в окрестности точки x_0 :

$$f(x) \approx f(x_0) + (x - x_0)f'(x_0).$$

Воспользуемся этим разложением для аппроксимированного Э.Р.:

- Пусть $x = h_{T-1}(x_i) + \alpha_T y_i b_T(x_i)$, $x_0 = h_{T-1}(x_i)$

⁴Mason, L., Baxter, J., Bartlett, P. L., and Frean, M. R. (2000). “Boosting algorithms as gradient descent”

Перейдём к более общему случаю:

- Недискретным ответам базовых алгоритмов, т.е. $b_t : X \rightarrow \mathbb{R}$
- Функции потерь $L(h_T)$, гладкой от величины $h_T(x_i) = y_i \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x_i)$

Принцип минимизации аппроксимированного Э.Р.:


$$R_T \leq \tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(h_{T-1}(x_i) + \alpha_T y_i b_T(x_i)) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}.$$

Вспомним разложение Тейлора функции $f(x)$ в окрестности точки x_0 :

$$f(x) \approx f(x_0) + (x - x_0)f'(x_0).$$

Воспользуемся этим разложением для аппроксимированного Э.Р.:

- Пусть $x = h_{T-1}(x_i) + \alpha_T y_i b_T(x_i)$, $x_0 = h_{T-1}(x_i)$
- Тогда $\tilde{R}_T \approx \sum_{i=1}^m L(h_{T-1}(x_i)) + \alpha_T \sum_{i=1}^m L'(h_{T-1}(x_i)) y_i b_T(x_i)$

⁴Mason, L., Baxter, J., Bartlett, P. L., and Frean, M. R. (2000). "Boosting algorithms as gradient descent" 

Перейдём к более общему случаю:

- Недискретным ответам базовых алгоритмов, т.е. $b_t : X \rightarrow \mathbb{R}$
- Функции потерь $L(h_T)$, гладкой от величины $h_T(x_i) = y_i \sum_{t=1}^T \alpha_t b_t(x_i)$

Принцип минимизации аппроксимированного Э.Р.:

$$R_T \leq \tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(h_{T-1}(x_i) + \alpha_T y_i b_T(x_i)) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}.$$

Вспомним разложение Тейлора функции $f(x)$ в окрестности точки x_0 :

$$f(x) \approx f(x_0) + (x - x_0)f'(x_0).$$

Воспользуемся этим разложением для аппроксимированного Э.Р.:

- Пусть $x = h_{T-1}(x_i) + \alpha_T y_i b_T(x_i)$, $x_0 = h_{T-1}(x_i)$
- Тогда $\tilde{R}_T \approx \sum_{i=1}^m L(h_{T-1}(x_i)) + \alpha_T \sum_{i=1}^m L'(h_{T-1}(x_i)) y_i b_T(x_i)$
- Обозначив за $w_i = -L'(h_{T-1}(x_i))$, получаем
$$\tilde{R}_T \approx \sum_{i=1}^m L(h_{T-1}(x_i)) - \alpha_T \sum_{i=1}^m w_i y_i b_T(x_i)$$

⁴Mason, L., Baxter, J., Bartlett, P. L., and Frean, M. R. (2000). "Boosting algorithms as gradient descent" 

$$\tilde{R}_T \approx \sum_{i=1}^m L(h_{T-1}(x_i)) - \alpha_T \sum_{i=1}^m w_i y_i b_T(x_i)$$

Зафиксировав α_T , переходим от задачи двумерной оптимизации $\tilde{R}_T \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$ к одномерной (по алгоритму):



$$\tilde{R}_T \approx \sum_{i=1}^m L(h_{T-1}(x_i)) - \alpha_T \sum_{i=1}^m w_i y_i b_T(x_i)$$

Зафиксировав α_T , переходим от задачи двумерной оптимизации $\tilde{R}_T \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$ к одномерной (по алгоритму):

$$\sum_{i=1}^m w_i y_i b_T(x_i) \rightarrow \max_{b_T}$$



$$\tilde{R}_T \approx \sum_{i=1}^m L(h_{T-1}(x_i)) - \alpha_T \sum_{i=1}^m w_i y_i b_T(x_i)$$

Зафиксировав α_T , переходим от задачи двумерной оптимизации $\tilde{R}_T \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$ к одномерной (по алгоритму):

$$\sum_{i=1}^m w_i y_i b_T(x_i) \rightarrow \max_{b_T}$$

Затем определяем α_T , подставив найденный b_T .



Алгоритм

- Инициализация: $h_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m,$



Алгоритм

- Инициализация: $h_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m,$

Для $t = 1, \dots, T$

- Вычисление весов $w_i = -L'(h_{t-1}(x_i)),$



Алгоритм

- Инициализация: $h_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m,$

Для $t = 1, \dots, T$

- Вычисление весов $w_i = -L'(h_{t-1}(x_i)),$
- Обучение нового базового алгоритма $b_t = \arg \max_{b \in A} \sum_{i=1}^m w_i y_i b(x_i),$



Алгоритм

- Инициализация: $h_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m,$

Для $t = 1, \dots, T$

- Вычисление весов $w_i = -L'(h_{t-1}(x_i)),$
- Обучение нового базового алгоритма $b_t = \arg \max_{b \in A} \sum_{i=1}^m w_i y_i b(x_i),$
- Вычисление нового веса $\alpha_t = \arg \min_{\alpha} \sum_{i=1}^m L(h_{t-1}(x_i) + \alpha y_i b_t(x_i)),$



Алгоритм

- Инициализация: $h_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m,$

Для $t = 1, \dots, T$

- Вычисление весов $w_i = -L'(h_{t-1}(x_i)),$
- Обучение нового базового алгоритма $b_t = \arg \max_{b \in A} \sum_{i=1}^m w_i y_i b(x_i),$
- Вычисление нового веса $\alpha_t = \arg \min_{\alpha} \sum_{i=1}^m L(h_{t-1}(x_i) + \alpha y_i b_t(x_i)),$
- Обновление $h_t(x_i) = h_{t-1}(x_i) + \alpha_t y_i b_t(x_i).$



Градиентный бустинг⁵ – обозначения

Рассмотрим самый общий случай – произвольную функцию потерь $L(a, y)$.

Функционал качества: $\tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(\sum_{t=1}^{T-1} \alpha_t b_t(x_i) + \alpha_T b_T(x_i), y_i) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$.

⁵Friedman, J. H. (1999). "Greedy function approximation: a gradient boosting machine".

Градиентный бустинг⁵ – обозначения

Рассмотрим самый общий случай – произвольную функцию потерь $L(a, y)$.

Функционал качества: $\tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(\sum_{t=1}^{T-1} \alpha_t b_t(x_i) + \alpha_T b_T(x_i), y_i) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$.

Обозначения:

- Приближение для объекта x_i на шаге t : $f_t(x_i)$,

⁵Friedman, J. H. (1999). "Greedy function approximation: a gradient boosting machine".

Градиентный бустинг⁵ – обозначения

Рассмотрим самый общий случай – произвольную функцию потерь $L(a, y)$.

Функционал качества: $\tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(\sum_{t=1}^{T-1} \alpha_t b_t(x_i) + \alpha_T b_T(x_i), y_i) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$.

Обозначения:

- Приближение для объекта x_i на шаге t : $f_t(x_i)$,
- Тогда функционал качества примет вид:
$$\tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(f_{T-1}(x_i) + \alpha_T b_T(x_i), y_i) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$$

⁵Friedman, J. H. (1999). "Greedy function approximation: a gradient boosting machine".

Градиентный бустинг – обоснование

$$\tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(f_{T-1}(x_i) + \alpha_T b_T(x_i), y_i) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$$



Градиентный бустинг – обоснование

$$\tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(f_{T-1}(x_i) + \alpha_T b_T(x_i), y_i) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$$

Применение **градиентного спуска** для данной задачи:

Градиентный бустинг – обоснование

$$\tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(f_{T-1}(x_i) + \alpha_T b_T(x_i), y_i) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$$

Применение **градиентного спуска** для данной задачи:

- $f_T(x_i) = f_{T-1}(x_i) - \eta g_i$, где $g_i = L'(f_{T-1}(x_i), y_i)$



Градиентный бустинг – обоснование

$$\tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(f_{T-1}(x_i) + \alpha_T b_T(x_i), y_i) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$$

Применение **градиентного спуска** для данной задачи:

- $f_T(x_i) = f_{T-1}(x_i) - \eta g_i$, где $g_i = L'(f_{T-1}(x_i), y_i)$

Сравните с итерацией **бустинга**:

- $f_T(x_i) = f_{T-1}(x_i) + \alpha_T b_T(x_i)$



Градиентный бустинг – обоснование

$$\tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(f_{T-1}(x_i) + \alpha_T b_T(x_i), y_i) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$$

Применение **градиентного спуска** для данной задачи:

- $f_T(x_i) = f_{T-1}(x_i) - \eta g_i$, где $g_i = L'(f_{T-1}(x_i), y_i)$

Сравните с итерацией **бустинга**:

- $f_T(x_i) = f_{T-1}(x_i) + \alpha_T b_T(x_i)$



Градиентный бустинг – обоснование

$$\tilde{R}_T = \sum_{i=1}^m L(f_{T-1}(x_i) + \alpha_T b_T(x_i), y_i) \rightarrow \min_{\alpha_T, b_T}$$

Применение **градиентного спуска** для данной задачи:

- $f_T(x_i) = f_{T-1}(x_i) - \eta g_i$, где $g_i = L'(f_{T-1}(x_i), y_i)$

Сравните с итерацией **бустинга**:

- $f_T(x_i) = f_{T-1}(x_i) + \alpha_T b_T(x_i)$



Основная идея градиентного бустинга

Поиск нового базового алгоритма b_T для приближения антиградиента $(-L'(f_{T-1}(x_i), y_i))$, т.е. минимизация квадратичной ошибки:

$$b_T = \arg \min_{b \in A} \sum_{i=1}^m (b(x_i) - (-L'(f_{T-1}(x_i), y_i)))^2.$$

Алгоритм

- Инициализация приближений: $f_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m,$



Алгоритм

- Инициализация приближений: $f_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m,$

Для $t = 1, \dots, T$

- Обучение нового базового алгоритма $b_t = \arg \min_{b \in A} \sum_{i=1}^m (b(x_i) + L'(f_{t-1}(x_i), y_i))^2,$



Алгоритм

- Инициализация приближений: $f_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m,$

Для $t = 1, \dots, T$

- Обучение нового базового алгоритма $b_t = \arg \min_{b \in A} \sum_{i=1}^m (b(x_i) + L'(f_{t-1}(x_i), y_i))^2,$
- Вычисление нового веса $\alpha_t = \arg \min_{\alpha} \sum_{i=1}^m L(f_{t-1}(x_i) + \alpha b_t(x_i), y_i),$



Алгоритм градиентного бустинга

Алгоритм

- Инициализация приближений: $f_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m,$

Для $t = 1, \dots, T$

- Обучение нового базового алгоритма $b_t = \arg \min_{b \in A} \sum_{i=1}^m (b(x_i) + L'(f_{t-1}(x_i), y_i))^2,$
- Вычисление нового веса $\alpha_t = \arg \min_{\alpha} \sum_{i=1}^m L(f_{t-1}(x_i) + \alpha b_t(x_i), y_i),$
- Обновление приближений $f_t(x_i) = f_{t-1}(x_i) + \alpha_t b_t(x_i), i = 1, \dots, m.$



Связь градиентного бустинга с другими вариантами бустинга

На самом деле, градиентный бустинг – наиболее общий вариант бустинга:

Связь градиентного бустинга с другими вариантами бустинга

На самом деле, градиентный бустинг – наиболее общий вариант бустинга:

- Если положим $L(y_i, a(x_i)) = L(-y_i a(x_i))$, то получим AnyBoost,



Связь градиентного бустинга с другими вариантами бустинга

На самом деле, градиентный бустинг – наиболее общий вариант бустинга:

- Если положим $L(y_i, a(x_i)) = L(-y_i a(x_i))$, то получим AnyBoost,
- Если положим $L(y_i, a(x_i)) = e^{-y_i a(x_i)}$ и ограничим $b_t(x_i) \in \{-1, +1\}$, то получим AdaBoost.



Стохастический градиентный бустинг

Используем не всю обучающую выборку, а случайное подмножество объектов.

⁶Friedman, J. H. (1999). "Stochastic gradient boosting".

Стохастический градиентный бустинг

Используем не всю обучающую выборку, а случайное подмножество объектов.

Алгоритм SGB⁶

- Инициализация приближений: $f_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m,$

⁶Friedman, J. H. (1999). "Stochastic gradient boosting".

Стохастический градиентный бустинг

Используем не всю обучающую выборку, а случайное подмножество объектов.

Алгоритм SGB⁶

- Инициализация приближений: $f_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m$,

Для $t = 1, \dots, T$

- Выбор случайного подмножества $I \subseteq \{1, \dots, m\}$,

⁶Friedman, J. H. (1999). "Stochastic gradient boosting".

Стохастический градиентный бустинг

Используем не всю обучающую выборку, а случайное подмножество объектов.

Алгоритм SGB⁶

- Инициализация приближений: $f_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m$,

Для $t = 1, \dots, T$

- Выбор случайного подмножества $I \subseteq \{1, \dots, m\}$,
- Обучение нового базового алгоритма $b_t = \arg \min_{b \in A} \sum_{i \in I} (b(x_i) + L'(f_{t-1}(x_i), y_i))^2$,

⁶Friedman, J. H. (1999). "Stochastic gradient boosting".

Стохастический градиентный бустинг

Используем не всю обучающую выборку, а случайное подмножество объектов.

Алгоритм SGB⁶

- Инициализация приближений: $f_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m$,

Для $t = 1, \dots, T$

- Выбор случайного подмножества $I \subseteq \{1, \dots, m\}$,
- Обучение нового базового алгоритма $b_t = \arg \min_{b \in A} \sum_{i \in I} (b(x_i) + L'(f_{t-1}(x_i), y_i))^2$,
- Вычисление нового веса $\alpha_t = \arg \min_{\alpha} \sum_{i \in I} L(f_{t-1}(x_i) + \alpha b_t(x_i), y_i)$,

⁶Friedman, J. H. (1999). "Stochastic gradient boosting".

Стохастический градиентный бустинг

Используем не всю обучающую выборку, а случайное подмножество объектов.

Алгоритм SGB⁶

- Инициализация приближений: $f_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m$,

Для $t = 1, \dots, T$

- Выбор случайного подмножества $I \subseteq \{1, \dots, m\}$,
- Обучение нового базового алгоритма $b_t = \arg \min_{b \in A} \sum_{i \in I} (b(x_i) + L'(f_{t-1}(x_i), y_i))^2$,
- Вычисление нового веса $\alpha_t = \arg \min_{\alpha} \sum_{i \in I} L(f_{t-1}(x_i) + \alpha b_t(x_i), y_i)$,
- Обновление приближений $f_t(x_i) = f_{t-1}(x_i) + \alpha_t b_t(x_i), i \in I$.

⁶Friedman, J. H. (1999). "Stochastic gradient boosting".

Стохастический градиентный бустинг

Используем не всю обучающую выборку, а случайное подмножество объектов.

Алгоритм SGB⁶

- Инициализация приближений: $f_0(x_i) = 0, i = 1, \dots, m$,

Для $t = 1, \dots, T$

- Выбор случайного подмножества $I \subseteq \{1, \dots, m\}$,
- Обучение нового базового алгоритма $b_t = \arg \min_{b \in A} \sum_{i \in I} (b(x_i) + L'(f_{t-1}(x_i), y_i))^2$,
- Вычисление нового веса $\alpha_t = \arg \min_{\alpha} \sum_{i \in I} L(f_{t-1}(x_i) + \alpha b_t(x_i), y_i)$,
- Обновление приближений $f_t(x_i) = f_{t-1}(x_i) + \alpha_t b_t(x_i), i \in I$.

Замечание. Последние два шага можно делать и для всей выборки, но это медленнее (хотя и точнее).

⁶Friedman, J. H. (1999). "Stochastic gradient boosting".

Плюсы SGB

- Уменьшение времени обучения

Плюсы SGB

- Уменьшение времени обучения
 - Меньше объектов на каждом шаге

Плюсы SGB

- Уменьшение времени обучения
 - Меньше объектов на каждом шаге
- Ускорение сходимости

Плюсы SGB

- Уменьшение времени обучения
 - Меньше объектов на каждом шаге
- Ускорение сходимости
 - Меньше шагов

Градиентный бустинг на решающих деревьях

Пусть каждый базовый алгоритм – это CART-дерево $b_t(x) = \sum_{j=1}^{J^t} r_j^t [x \in R_j^t]$, где

⁷Friedman, J. H. (1999). "Greedy function approximation: a gradient boosting machine".



Градиентный бустинг на решающих деревьях

Пусть каждый базовый алгоритм – это CART-дерево $b_t(x) = \sum_{j=1}^{J^t} r_j^t [x \in R_j^t]$, где

- Пространство делится на J^t непересекающихся областей (листов) $R_1^t, \dots, R_{J^t}^t$,

⁷Friedman, J. H. (1999). "Greedy function approximation: a gradient boosting machine".

Градиентный бустинг на решающих деревьях

Пусть каждый базовый алгоритм – это CART-дерево $b_t(x) = \sum_{j=1}^{J^t} r_j^t [x \in R_j^t]$, где

- Пространство делится на J^t непересекающихся областей (листов) $R_1^t, \dots, R_{J^t}^t$,
- Значение r_j^t в листе R_j^t – это среднее значение по обучающим примерам из этой области:
$$r_j^t = \frac{\sum_{i=1}^m y_i [x_i \in R_j^t]}{\sum_{i=1}^m [x_i \in R_j^t]}$$

⁷Friedman, J. H. (1999). "Greedy function approximation: a gradient boosting machine".

Градиентный бустинг на решающих деревьях

Пусть каждый базовый алгоритм – это CART-дерево $b_t(x) = \sum_{j=1}^{J^t} r_j^t [x \in R_j^t]$, где

- Пространство делится на J^t непересекающихся областей (листов) $R_1^t, \dots, R_{J^t}^t$,
- Значение r_j^t в листе R_j^t – это среднее значение по обучающим примерам из этой области:
$$r_j^t = \frac{\sum_{i=1}^m y_i [x_i \in R_j^t]}{\sum_{i=1}^m [x_i \in R_j^t]}$$

Варианты бустинга на деревьях⁷:

⁷Friedman, J. H. (1999). "Greedy function approximation: a gradient boosting machine".

Градиентный бустинг на решающих деревьях

Пусть каждый базовый алгоритм – это CART-дерево $b_t(x) = \sum_{j=1}^{J^t} r_j^t [x \in R_j^t]$, где

- Пространство делится на J^t непересекающихся областей (листов) $R_1^t, \dots, R_{J^t}^t$,
- Значение r_j^t в листе R_j^t – это среднее значение по обучающим примерам из этой области:
$$r_j^t = \frac{\sum_{i=1}^m y_i [x_i \in R_j^t]}{\sum_{i=1}^m [x_i \in R_j^t]}$$

Варианты бустинга на деревьях⁷:

- **Общего вида.** На каждом шаге находится ровно один параметр α_t :
$$f_t(x_i) = f_{t-1}(x_i) + \alpha_t b_t(x_i),$$

⁷Friedman, J. H. (1999). "Greedy function approximation: a gradient boosting machine".

Градиентный бустинг на решающих деревьях

Пусть каждый базовый алгоритм – это CART-дерево $b_t(x) = \sum_{j=1}^{J^t} r_j^t [x \in R_j^t]$, где

- Пространство делится на J^t непересекающихся областей (листов) $R_1^t, \dots, R_{J^t}^t$,
- Значение r_j^t в листе R_j^t – это среднее значение по обучающим примерам из этой области: $r_j^t = \frac{\sum_{i=1}^m y_i [x_i \in R_j^t]}{\sum_{i=1}^m [x_i \in R_j^t]}$

Варианты бустинга на деревьях⁷:

- **Общего вида.** На каждом шаге находится ровно один параметр α_t :
$$f_t(x_i) = f_{t-1}(x_i) + \alpha_t b_t(x_i),$$
- **Улучшенный.** На каждом шаге находятся J^t параметров α_j^t :
$$f_t(x_i) = f_{t-1}(x_i) + \sum_{j=1}^{J^t} \alpha_j^t r_j^t [x_i \in R_j^t].$$

⁷Friedman, J. H. (1999). "Greedy function approximation: a gradient boosting machine".

- Бэггинг (благодаря процедуре бутстрэпа) может работать на небольших выборках,

- Бэггинг (благодаря процедуре бутстрэпа) может работать на небольших выборках,
- Бустинг лучше работает на больших выборках (но и ошибка, скорее всего, будет меньше),

- Бэггинг (благодаря процедуре бутстрэпа) может работать на небольших выборках,
- Бустинг лучше работает на больших выборках (но и ошибка, скорее всего, будет меньше),
- Стековое обобщение можно использовать как средство “выжимания” последних долей процента,



- Бэггинг (благодаря процедуре бутстрэпа) может работать на небольших выборках,
- Бустинг лучше работает на больших выборках (но и ошибка, скорее всего, будет меньше),
- Стековое обобщение можно использовать как средство “выжимания” последних долей процента,
- Бэггинг лучше всего параллелится,



- Бэггинг (благодаря процедуре бутстрэпа) может работать на небольших выборках,
- Бустинг лучше работает на больших выборках (но и ошибка, скорее всего, будет меньше),
- Стековое обобщение можно использовать как средство “выжимания” последних долей процента,
- Бэггинг лучше всего параллелится,
- Бустинг позволяет фильтровать выбросы,



- Бэггинг (благодаря процедуре бутстрэпа) может работать на небольших выборках,
- Бустинг лучше работает на больших выборках (но и ошибка, скорее всего, будет меньше),
- Стековое обобщение можно использовать как средство “выжимания” последних долей процента,
- Бэггинг лучше всего параллелится,
- Бустинг позволяет фильтровать выбросы,
- Метод случайных подпространств (бутстрэп на признаках) необходим, когда у нас признаков очень много (или много шумовых).





На основе материалов сайта <http://www.machinelearning.ru>.