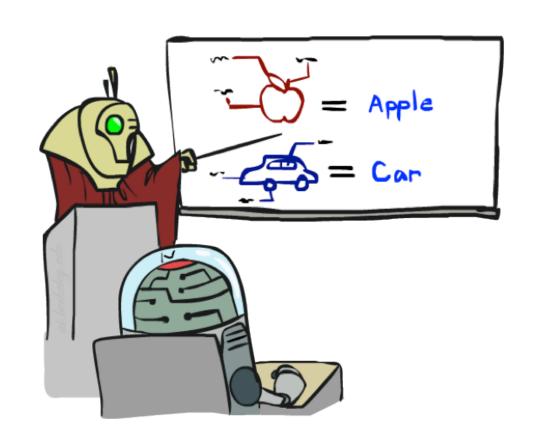
第十八章 样例学习

Learning from examples



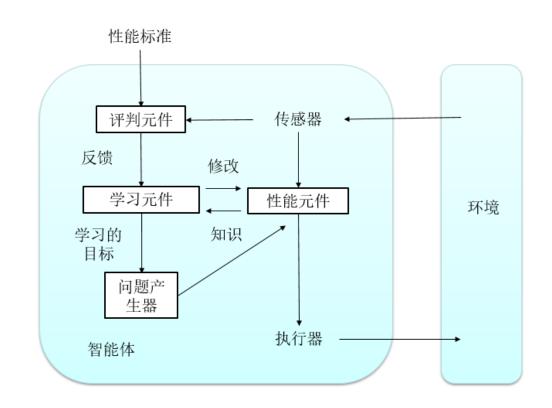
Outline

- 18.1 学习形式
- 18.2 监督学习
- 18.3 决策树归纳



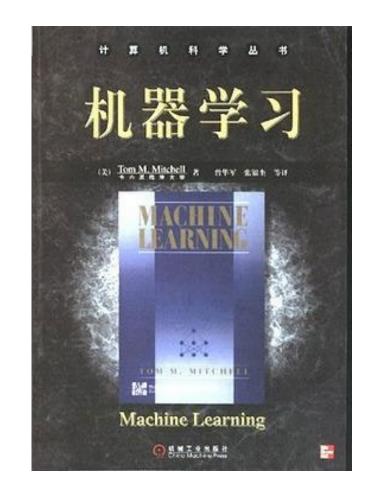
▶什么是学习

- 学习是一个过程,通过学习可以对Agent 的性能进行改进
- Simon: 学习就是系统中的变化,这种变化使系统比以前更有效地去做同样的工作
- 对于未知环境,缺少全知,学习是必要的
- Agent任何部件的性能都可以通过从数据 中进行学习来改进



学习算法的定义

- 机器学习算法是一种能够<u>从数据中学习的算法</u>。 (Machine Learning/Example Learning/Inductive learning)
- "学习" 是什 么?
 - Mitchell (1997) 提供了一个简洁的定义:
 "对于某类任务 T和性能度量 P, 一个计算 机程序被认为可以从经验 E 中学习是指,通过经验 E 改进后,它在任务 T 上由性能 度量 P 衡量的性能有所提升。



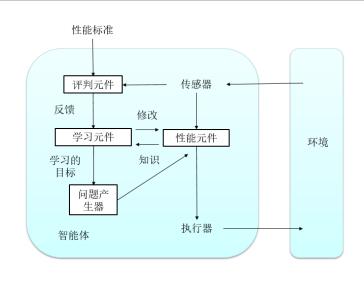
• 智能体性能的改进依赖以下四个主要因素:

- 要改进哪个部件?
- 使用什么样的表示法?
- Agent具备什么样的先验知识?
- 学习类型?

有监督学习

无监督学习/自监督学习 半监督学习

强化学习



• 问题求解Agent: 状态空间

• 逻辑Agent: 命题逻辑或一阶逻辑

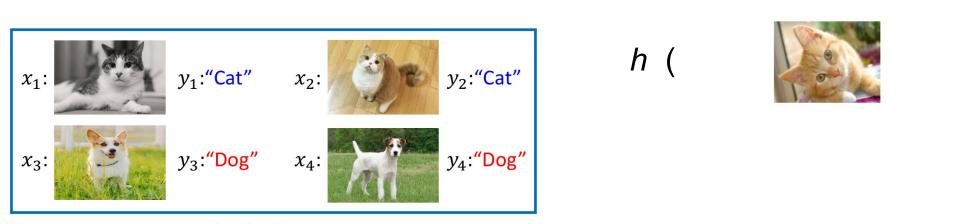
不确定推理Agent: 贝叶斯网络

• 有监督学习 (Supervised learning)

- 对每一个输入都有一个正确的目标输出,从一组输入 - 输出的实例数据集中, 学习出一个"输入-输出"的映射函数: Y=h(X) (模型参数)

)= "Cat"

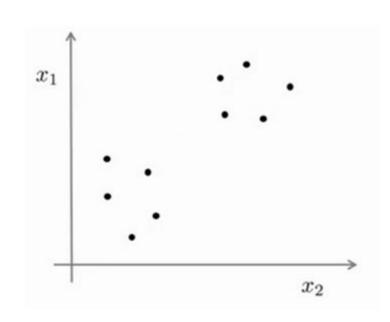
- 当新的数据到来时,可以根据h函数预测结果



Labelled Data

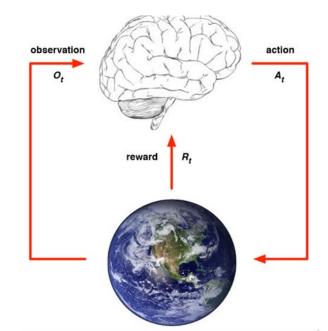
- 无监督学习 (Unsupervised learning)
 - 没有来自外部环境的直接反馈(输出值), 自组织学习输入的模式
 - 需要挖掘数据中的隐含规律
 - 最常见的任务是聚类

Training set: $\{x^{(1)}, x^{(2)}, x^{(3)}, \dots, x^{(m)}\}$



自监督学习(Self Supervised learning)

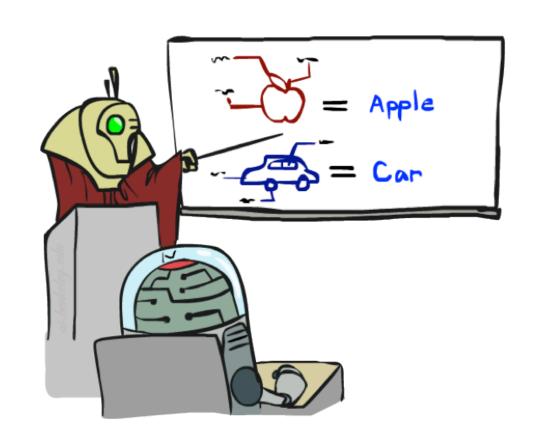
- 强化学习 (Reinforcement learning)
 - 外部环境仅给出一个对当前输出的一个评价(奖赏或惩罚信号),不会给出具体的期望输出
 - 系统从环境学习以使得奖励最大



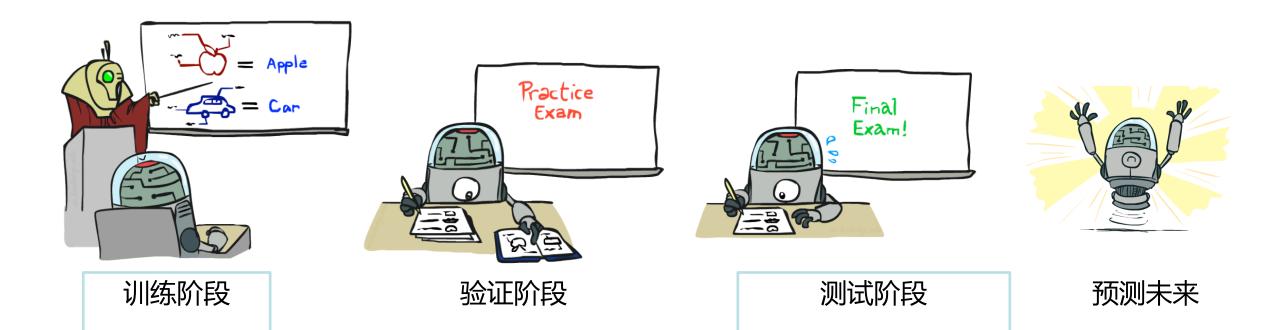


Outline

- 18.1 学习形式
- 18.2 监督学习
- 18.3 决策树归纳

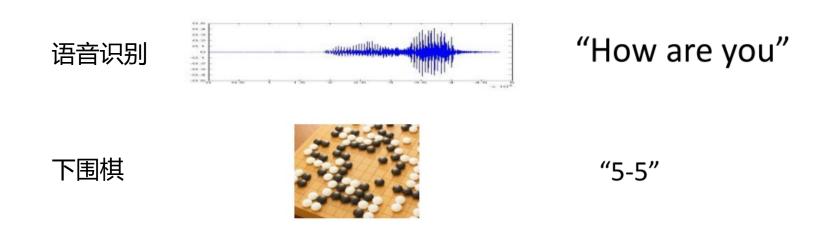


给定一个训练集N个样本, (x₁, y₁), (x₂, y₂),...(x_n, y_n), 其中,
 y_i=f(x_i), 真实的f是未知的。如果假说空间*H*中存在一个假说或者函数h (hypothesis), 使得h ≈ f, 就称 h 是一致假说 (consistent)



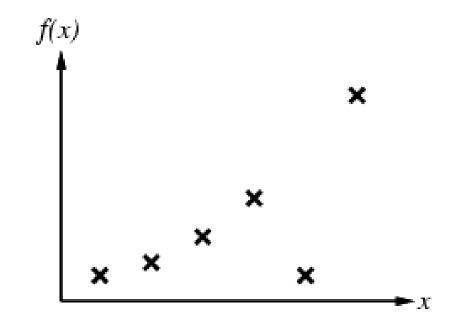
> 监督学习

• 分类学习问题: 如果输出y是离散的值

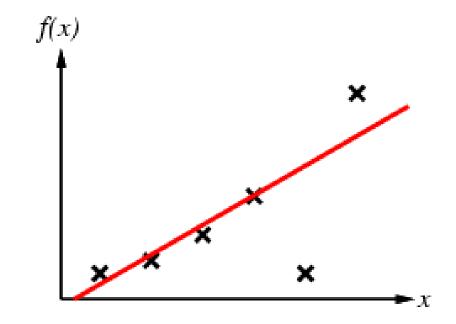


- 回归学习问题:如果y是一个连续的数值
 - 预测明天的最高温度

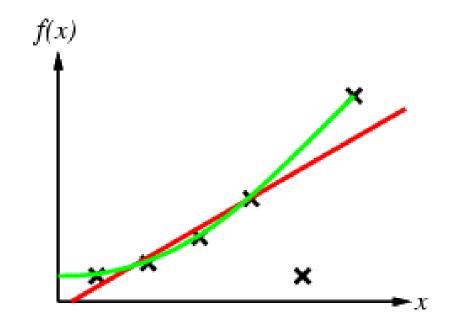
- 举例: 曲线拟合
 - 在某些数据点上拟合一个单变量 函数,样例是(x,y)平面上的点, 其中y=f(x)
 - 在真实函数f未知的情况下,用一个函数h逼近它



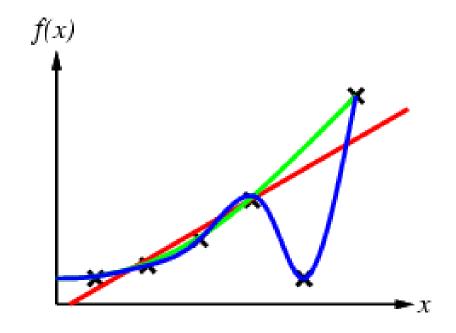
- 举例: 曲线拟合
 - 在某些数据点上拟合一个单变量 函数,样例是(x,y)平面上的点, 其中y=f(x)
 - 在真实函数f未知的情况下,用一个函数h逼近它



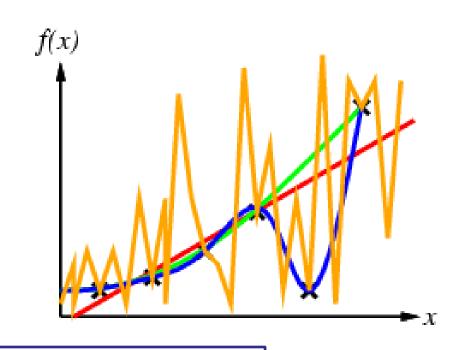
- 举例: 曲线拟合
 - 在某些数据点上拟合一个单变量 函数,样例是(x,y)平面上的点, 其中y=f(x)
 - 在真实函数f未知的情况下,用一个函数h逼近它



- 举例: 曲线拟合
 - 在某些数据点上拟合一个单变量 函数,样例是(x,y)平面上的点, 其中y=f(x)
 - 在真实函数f未知的情况下,用一个函数h逼近它



- 举例: 曲线拟合
 - 在真实函数f未知的情况下,用一个函数h逼近它
 - 较好拟合训练数据的复杂假说和 更好泛化的简单假说之间存在折中



归纳学习中的基本问题:如何从多个一致假说中抉择?

答案: 选择与数据一致的最简单的假说(奥坎姆剃刀)

监督学习

归纳偏好 (inductive bias)

$$x_5 = 5$$
, since $x_i = i$ for $i = 1..4$.
 $x_5 = 29$, since $x_i = i^4 - 10i^3 + 35i^2 - 49i + 24$.

Conclusion: We prefer 5, since linear relation involves less arbitrary parameters than 4th-order polynomial.

监督学习

Sequence: 14159265358979323846264338327950288419716939937?

Looks random?!

Frequency estimate: n = length of sequence. $k_i = \text{number of occurred}$ $i \Longrightarrow \text{Probability of next digit being } i \text{ is } \frac{k_i}{n}$.

Asymptotically $\frac{k_i}{n} \to \frac{1}{10}$ (seems to be) true.

But we have the strong feeling that (i.e. with high probability) the next digit will be 5 because the previous digits were the expansion of π .

Conclusion: We prefer answer 5, since we see more structure in the sequence than just random digits.

归纳偏好(inductive bias) 对应了学习算法本身所做出的关于"什么样的模型更好"的假设

Outline

- 机器学习
- 18.3 决策树归纳
 - 18.3.1 决策树表示法
 - 18.3.2 决策树的表达能力
 - 18.3.3 从样例归纳决策树
 - 18.3.4 选择测试属性



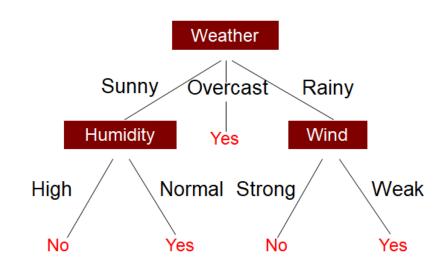
Decision Trees

- 决策树归纳是一类最简单的机器学习形式,是一种以样例为基础的归纳学习方法
- 从一组训练数据中学习到的函数,一棵决策树表示一个函数: y = f(x)

■ 输入x: 属性值向量

■ 输出y: 一个决策

- 输入输出可以离散的,也可以连续的
- 布尔分类 (二分类)
 - 输入值是离散的,输出为二值的情况
 - 输出为真:正例
 - 输出为假: 反例



Play Tennis的决策树

决策树学习 - 就餐问题

基于下面的10个属性,决定是否要在餐馆等座位?

- 1. Alternate (候选): 附近是否有另一家合适的餐馆?
- 2. Bar (酒吧):该餐馆中供顾客等候的吧区是否舒适?
- 3. Fri/Sat(周五/周六)是周五或周六吗?
- 4. Hungry(饥饿)是否饥饿?
- 5. Patrons(顾客):该餐馆中有多少顾客(None, Some, Full)
- 6. Price (价格):餐馆的价格范围(\$,\$\$,\$\$\$)
- 7. Raining (下雨)外面是否在下雨?
- 8. Reservation (预约): 是否预约过?
- 9. Type (类型): 餐馆的种类(French, Italian, Thai, Burger)
- 10. WaitEstimate (等候时间估计):估计的等候时间(0-10, 10-30, 30-60, >60)

基于属性的表示

- 决定是否要在餐馆等座位的实例集X₁~X₁₂
- 实例是通过属性值描述的

Ex	kample					At	tributes	3				Target
		Alt	Bar	Fri	Hun	Pat	Price	Rain	Res	Type	Est	Wait
	X_1	Т	F	F	Т	Some	\$\$\$	F	Т	French	0–10	Т
	X_2	Т	F	F	Т	Full	\$	F	F	Thai	30–60	F
	X_3	F	Т	F	F	Some	\$	F	F	Burger	0–10	Т
	X_4	Т	F	Т	Т	Full	\$	F	F	Thai	10–30	Т
	X_5	Т	F	Т	F	Full	\$\$\$	F	Т	French	>60	F
	X_6	F	Т	F	Т	Some	\$\$	Т	Т	Italian	0-10	Т
	X_7	F	Т	F	F	None	\$	Т	F	Burger	0–10	F
	X_8	F	F	F	Т	Some	\$\$	Т	Т	Thai	0–10	Т
	X_9	F	Т	Т	F	Full	\$	Т	F	Burger	>60	F
	X_{10}	Т	Т	Т	Т	Full	\$\$\$	F	Т	Italian	10-30	F
	X_{11}	F	F	F	F	None	\$	F	F	Thai	0-10	F
	X_{12}	Т	Т	Т	Т	Full	\$	F	F	Burger	30–60	Т

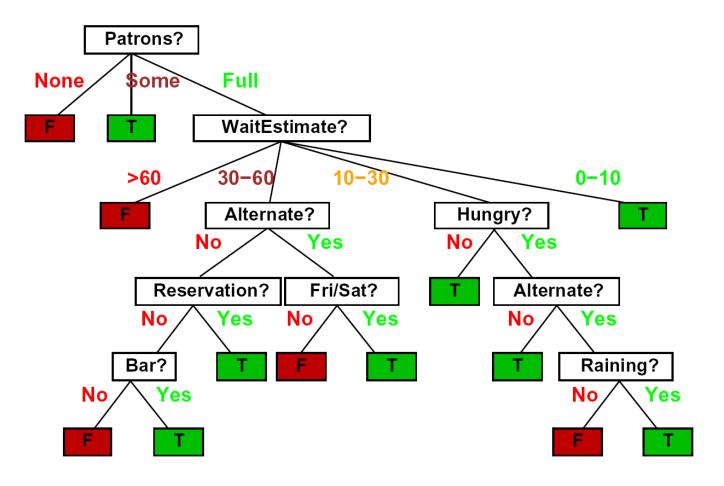
• 实例分类: 正(T)、负(F)

输入属性值的可能组合9216种, 仅通过12个样例学习,对缺失

的9204个输出值给出预测。

Decision Trees

- 假设空间的一种可能表示
- 决策树通过把实例从根节点排列到某个叶子节点来分类



■ 一棵决策树表示一个函数: y = f(x)

Example	Example Attributes											
	Alt	Bar	Fri	Hun	Pat	Price	Rain	Res	Type	Est	Wait	

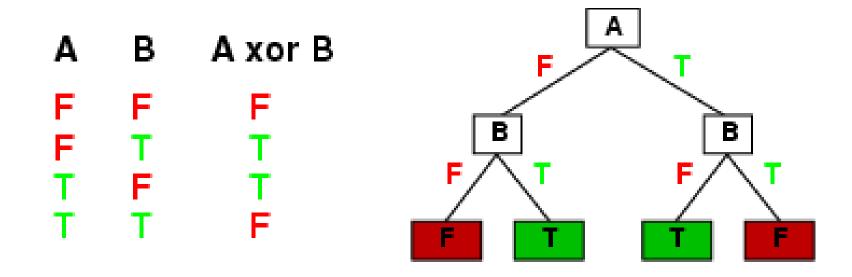
- x= (Yes, No, No, Yes, Some, ..., No)
- *y* = ?

Outline

- 18.2 监督学习
- 18.3 决策树归纳
 - 18.3.1 决策树表示法
 - 18.3.2 决策树的表达能力
 - 18.3.3 从样例归纳决策树
 - 18.3.4 选择测试属性

决策树的表示能力

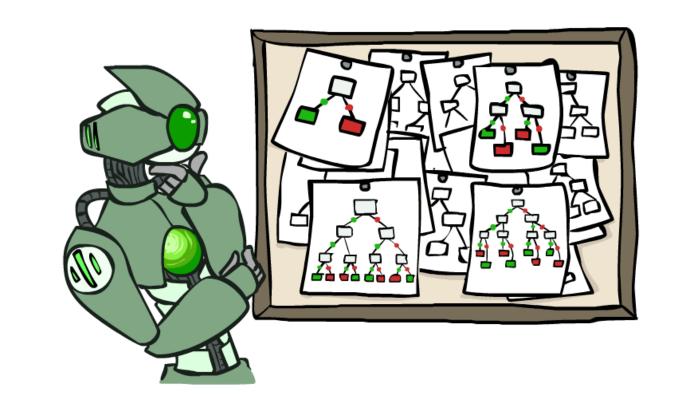
- 决策树能表示输入属性的任何函数
- 对布尔型函数, 真值表中每一行对应树中根到叶节点的一条路径:



决策树的表示能力

• 对于具有10个布尔属性的 饭店例子,有2¹⁰²⁴或者大 约10³⁰⁸个候选的函数

• 在如此大的空间中寻找好的假说,需要设计精巧的算法



决策树学习要点

- 目标: 找到和训练集一致的较小的树 (树中所有的路径都很短,整棵树的规模比较小)
- 思想: 递归地选择"最好"或"最佳"的属性作为树或子树的根,通过较少数量的测试就能得到正确的分类
- 最好: 分类能力最好

Outline

- 18.2 监督学习
- 18.3 决策树归纳
 - 18.3.1 决策树表示法
 - 18.3.2 决策树的表达能力
 - 18.3.3 从样例归纳决策树
 - 18.3.4 选择测试属性

Features and examples

■ 就餐问题的样例

- 12 个训练样例
- 10个分类属性
- 目标*WillWait*(真:正例, 假:反例)

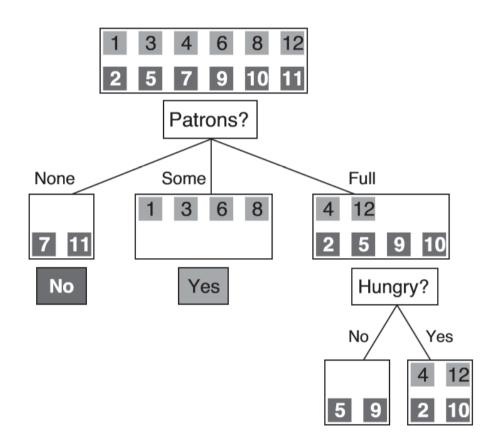
Example					At	tributes	<u>'</u>				Target
	Alt	Bar	Fri	Hun	Pat	Price	Rain	Res	Type	Est	WillWait
X_1	T	F	F	T	Some	\$\$\$	F	T	French	0–10	T
X_2	T	F	F	T	Full	\$	F	F	Thai	30–60	F
X_3	F	T	F	F	Some	\$	F	F	Burger	0–10	T
X_4	T	F	T	T	Full	\$	F	F	Thai	10–30	T
X_5	T	F	Τ	F	Full	<i>\$\$\$</i>	F	T	French	>60	F
X_6	F	Τ	F	T	Some	<i>\$\$</i>	\mathcal{T}	T	ltalian	0–10	T
X_7	F	Τ	F	F	None	\$	\mathcal{T}	F	Burger	0–10	F
X_8	F	F	F	T	Some	<i>\$\$</i>	Τ	T	Thai	0–10	T
X_9	F	Τ	Τ	F	Full	\$	Τ	F	Burger	>60	F
X_{10}	T	T	T	T	Full	<i>\$\$\$</i>	F	T	ltalian	10–30	F
X_{11}	F	F	F	F	None	\$	F	F	Thai	0–10	F
X_{12}	T	T	T	T	Full	\$	F	F	Burger	30–60	T

目标: 寻找一棵决策树: 与样例一致, 且规模尽可能小。

即:通过较少的测试达到正确分类。

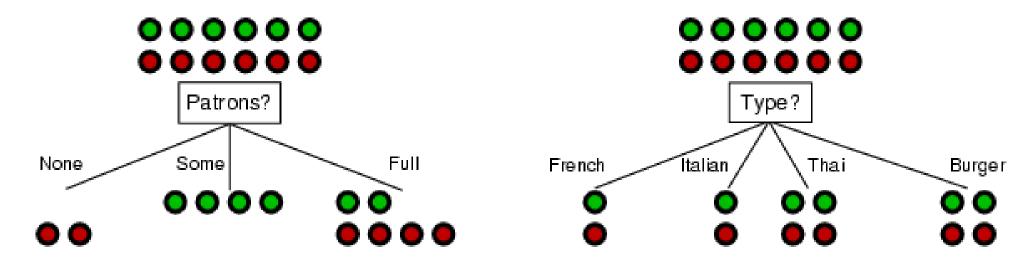
Decision Tree Learning

- 采用贪婪"分而治之" (Divide- and -conquer) 的策略
 - 将问题分解为更小的子问题,这些子问题又可以 被递归求解
 - 总是优先测试最重要的属性
 - "最重要的属性": 对于样例分类具有最大差异的 属性



选择一个属性

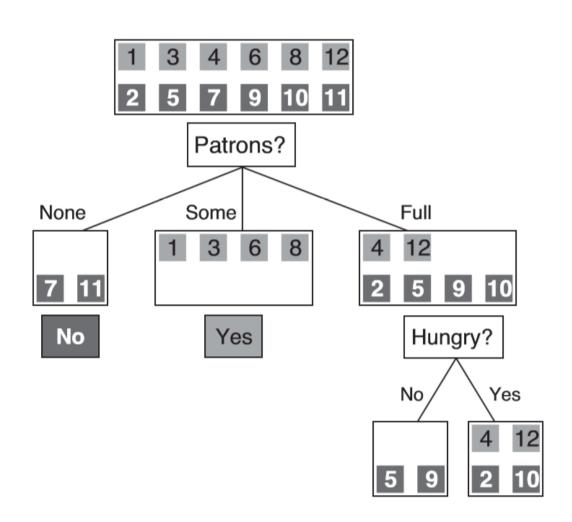
- 采用贪婪"分而治之" (Divide- and -conquer) 的策略
 - 总是优先测试最重要的属性
 - "最重要的属性": 对于样例分类具有最大差异的属性



Decision Tree Learning

■ 决策树生成要考虑4种情况:

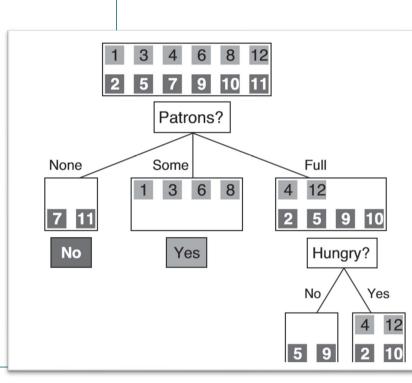
- 1.如果剩余样例都是正例(或反例),则 返回,可回答Yes或No
- 2.如果既有正例又有反例,则选择最好属性继续分裂
- 3.如果没有留下任何<u>样例</u>,则返回一个缺省值(父结点样例中最常见的输出)
- 4. 如果没有<u>属性</u>,返回剩余样例中得票 最多的分类。



Decision Tree Learning

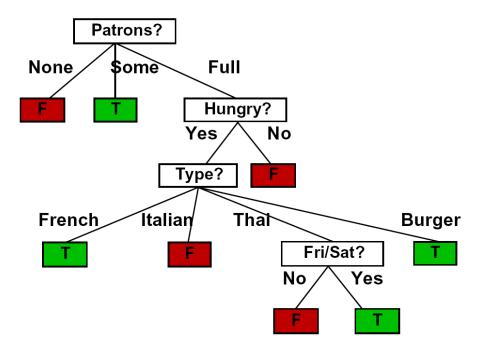
- Aim: find a small tree consistent with the training examples
- Idea: (recursively) choose "most significant" attribute as root of (sub)tree

```
function Decision-Tree-Learning(examples, attributes, parent_examples) returns
a tree
  if examples is empty then return PLURALITY-VALUE(parent_examples)
  else if all examples have the same classification then return the classification
  else if attributes is empty then return PLURALITY-VALUE(examples)
  else
      A \leftarrow \operatorname{argmax}_{a \in attributes} \mathsf{IMPORTANCE}(a, examples)
      tree \leftarrow a new decision tree with root test A
      for each value v_k of A do
          exs \leftarrow \{e : e \in examples \text{ and } e.A = v_k\}
          subtree \leftarrow \text{DECISION-TREE-LEARNING}(exs, attributes - A, examples)
          add a branch to tree with label (A = v_k) and subtree subtree
      return tree
```



Example: Learned Tree

Decision tree learned from these 12 examples:



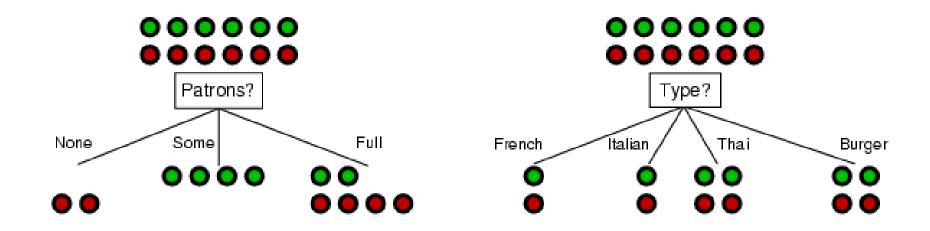
- Substantially simpler than "true" tree
- Also: it's reasonable

Outline

- 18.2 监督学习
- 18.3 决策树归纳
 - 18.3.1 决策树表示法
 - 18.3.2 决策树的表达能力
 - 18.3.3 从样例归纳决策树
 - 18.3.4 选择测试属性

选择一个属性

• 思想: 理想的属性是将实例分为只包含正例或只包含反例的集合

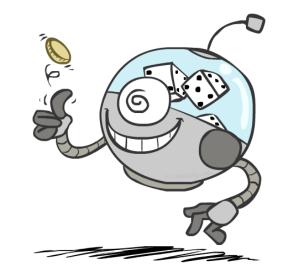


- Patrons? 不理想,但是很不错
- we need a measure of how "good" a split is, even if the results aren't perfectly separated out

Entropy and Information

■ 形式化度量"相当好"和"真正无用",使用<mark>信息收益</mark>的概念定义属性的Importance

- 熵是信息论中的基本量 (Shannon, Weaver, 1949)
 - 熵是随机变量的不确定性度量,量化整个概率分布中的不确定性总量
 - 不确定性越小,熵越小
 - 单位:比特
 - 一般地,设<mark>随机变量V</mark>取值为 v_k 的概率: $P(v_k)$,则V的熵定义为:



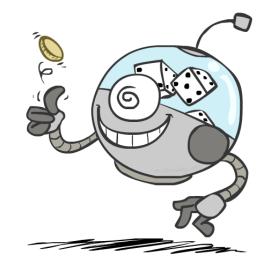
Entropy:
$$H(V) = \sum_{k} P(v_k) \log_2 \frac{1}{P(v_k)} = -\sum_{k} P(v_k) \log_2 P(v_k)$$

Entropy and Information

- 熵是信息论中的基本量 (Shannon, Weaver, 1949)
 - 熵是随机变量的不确定性度量
 - Scale: bits

Entropy:
$$H(V) = \sum_{k} P(v_k) \log_2 \frac{1}{P(v_k)} = -\sum_{k} P(v_k) \log_2 P(v_k)$$

- Answer to Boolean question with prior <1/2, 1/2>? 抛硬币的熵
- Answer to 4-way question with prior <1/4, 1/4, 1/4, 1/4>?四面色子的熵
- Answer to 4-way question with prior <0, 0, 0, 1>?
- Answer to 3-way question with prior <1/2, 1/4, 1/4>?

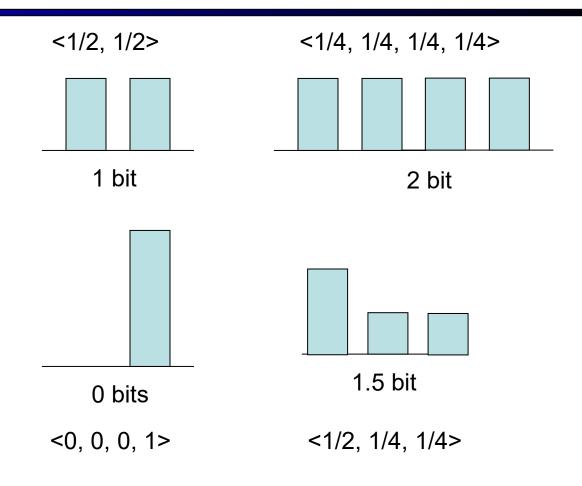


Entropy

- Also called the entropy of the distribution
 - More uniform = higher entropy
 - More values = higher entropy
 - More peaked = lower entropy

■ 设布尔随机变量以q的概率为真,则可以 定义该变量的熵:

$$B(q) = -(q \log_2 q + (1 - q) \log_2 (1 - q))$$



Entropy

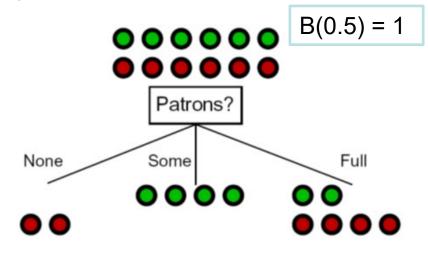
■ 设布尔随机变量以q的概率为真,则可以定义该变量的熵:

$$B(q) = -(q \log_2 q + (1 - q) \log_2 (1 - q))$$

■ 例如,一个训练集包括p个正例样本和 n 个负例样本,目标属性的熵:

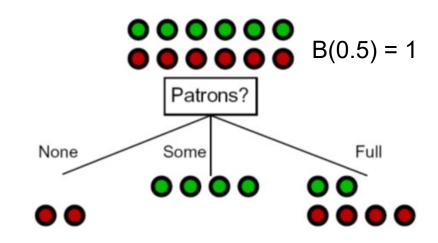
$$H(Goal) = B\left(\frac{p}{p+n}\right)$$

$$= -\frac{p}{p+n}\log_2\frac{p}{p+n} - \frac{n}{p+n}\log_2\frac{n}{p+n}$$



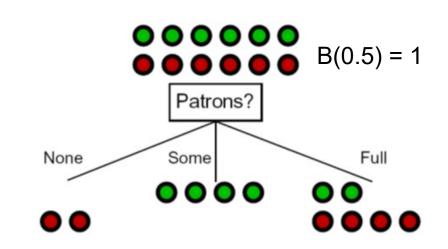
• 信息增益 (Information Gain) : 一个属性A的信息增益就是由于使用这个 属性分裂样例而导致的期望熵降低,即不确定性的减少量

$$Gain(A) = B(\frac{p}{p+n}) - Remainder(A)$$



• Remainder(A)是用属性A测试后剩余的<u>期望</u>熵:一个属性A假定有 ℓ 个不同的取值,根据其取值可以将数据集E分成 E_1, \ldots, E_{ℓ} 子集,每个子集 E_i 包含 E_1 0, E_2 0, E_3 0。 E_4 1, E_4 3。 E_5 4。 E_6 5。

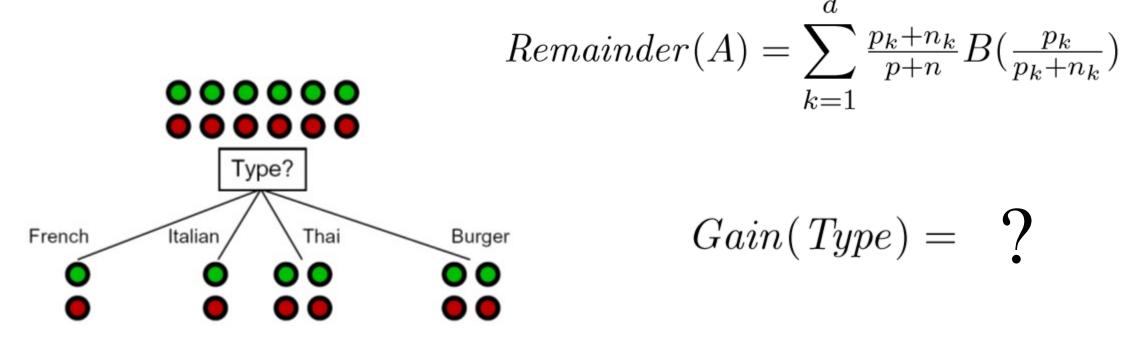
$$Remainder(A) = \sum_{k=1}^{d} \frac{p_k + n_k}{p + n} B(\frac{p_k}{p_k + n_k})$$



Remainder(A) =
$$\frac{2}{12}B(\frac{0}{2}) + \frac{4}{12}B(\frac{4}{4}) + \frac{6}{12}B(\frac{2}{6})$$

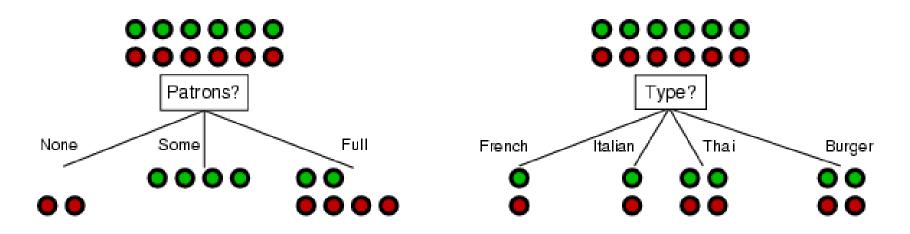
按属性A分裂的信息增益,是熵的期望降低的量

$$Gain(A) = B(\frac{p}{p+n}) - Remainder(A)$$



$$Gain(Type) = ?$$

k=1



$$Gain(Patrons) = 1 - \left[\frac{2}{12} B \left(\frac{0}{2} \right) + \frac{4}{12} B \left(\frac{4}{4} \right) + \frac{6}{12} B \left(\frac{2}{6} \right) \right] \approx 0.541$$
比特
$$Gain(Type) = 1 - \left[\frac{2}{12} B \left(\frac{1}{2} \right) + \frac{2}{12} B \left(\frac{1}{2} \right) + \frac{4}{12} B \left(\frac{2}{4} \right) + \frac{4}{12} B \left(\frac{2}{4} \right) \right] = 0$$
比特

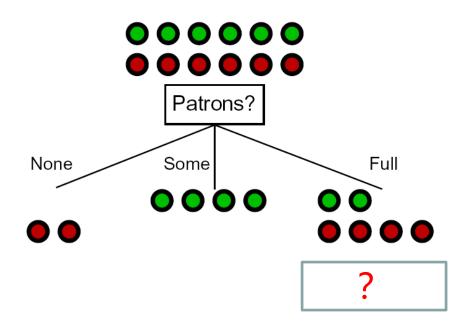
其他的属性的信息增益也可以进行类似的计算

结论: Patrons 具有最高的信息增益,被决策树算法选为决策树的根

Next Step: Recurse

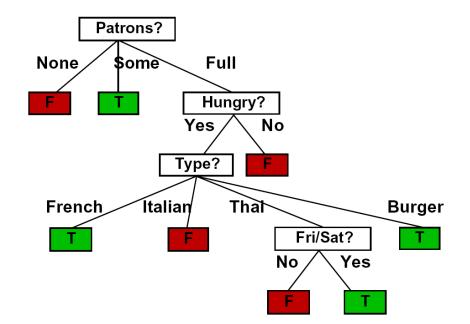
- 继续找下一个属性!
- Two branches are done
- What to do under "full"?
 - See what examples are there...

Example					At	tributes	}				Target
	Alt	Bar	Fri	Hun	Pat	Price	Rain	Res	Type	Est	WillWait
X_1	T	F	F	Τ	Some	\$\$\$	F	T	French	0–10	T
X_2	T	F	F	T	Full	\$	F	F	Thai	30–60	F
X_3	F	T	F	F	Some	\$	F	F	Burger	0–10	T
X_4	T	F	T	T	Full	\$	F	F	Thai	10–30	T
X_5	T	F	T	F	Full	\$\$\$	F	T	French	>60	F
X_6	F	T	F	Τ	Some	\$\$	Τ	T	Italian	0–10	T
X_7	F	T	F	F	None	\$	T	F	Burger	0–10	F
X_8	F	F	F	Τ	Some	\$\$	T	T	Thai	0–10	T
X_9	F	T	T	F	Full	\$	T	F	Burger	>60	F
X_{10}	T	T	T	T	Full	\$\$\$	F	T	Italian	10–30	F
X_{11}	F	F	F	F	None	\$	F	F	Thai	0–10	F
X_{12}	T	T	T	T	Full	\$	F	F	Burger	30–60	T



总结-选择测试属性

Example					At	tributes	;				Target
	Alt	Bar	Fri	Hun	Pat	Price	Rain	Res	Type	Est	WillWait
X_1	T	F	F	T	Some	\$\$\$	F	T	French	0–10	T
X_2	T	F	F	T	Full	\$	F	F	Thai	30–60	F
X_3	F	T	F	F	Some	\$	F	F	Burger	0–10	T
X_4	T	F	T	T	Full	\$	F	F	Thai	10–30	T
X_5	T	F	T	F	Full	\$\$\$	F	T	French	>60	F
X_6	F	T	F	T	Some	\$\$	\mathcal{T}	T	Italian	0–10	T
X_7	F	T	F	F	None	\$	T	F	Burger	0–10	F
X_8	F	F	F	T	Some	<i>\$\$</i>	T	T	Thai	0–10	T
X_9	F	T	T	F	Full	\$	T	F	Burger	>60	F
X_{10}	T	T	T	T	Full	\$\$\$	F	T	Italian	10–30	F
X_{11}	F	F	F	F	None	\$	F	F	Thai	0–10	F
X_{12}	T	T	T	T	Full	\$	F	F	Burger	30–60	T



$$H(Goal) = B\left(\frac{p}{p+n}\right)$$

$$B(q) = -(q \log_2 q + (1 - q) \log_2 (1 - q))$$

$$Remainder(A) = \sum_{k=1}^{d} \frac{p_k + n_k}{p + n} B(\frac{p_k}{p_k + n_k})$$

$$Gain(A) = B(\frac{p}{p+n}) - Remainder(A)$$

