

The Elements of Statistical Learning

Chap.18: High-Dimensional Problems: $p \gg N$

Kosuke Kito

August 28, 2020

Section 1

introduction
p.653-

本日のお題 - $p \gg N$ 問題

特徴量の数がサンプル数よりもずっと大きいとき ($p \gg N$) に困っちゃう話.

- ▶ 困っちゃうポイントは, high variance と overfitting
- ▶ simple, highly regularized な手法が使われる.
- ▶ 主な話題は以下の2つ.
 - ▶ prediction
 - ▶ feature selection, assesment

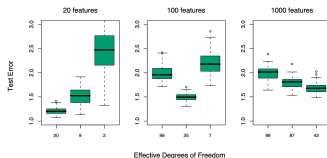


FIGURE 18.1. Test-error results for simulation experiments. Shown are boxplots of the relative test errors over 100 simulations, for three different values of p , the number of features. The relative error is the test error divided by the Bayes error, σ^2 . From left to right, results are shown for ridge regression with three different values of the regularization parameter λ : 0.001, 100 and 1000. The (average) effective degrees of freedom in the fit is indicated below each plot.

流れ

- ▶ 流れを書く.

Section 2

LDA の正則化 - Diagonal LDA と NSC
p.651-

LDA の復習 1 - コンセプト

$p \gg N$ 問題の最初の回避策は, “Diagonal LDA” という線型判別法の強烈な正則化バージョン.

とりあえず, LDA の復習. (不要であれば飛ばします.)

- ▶ 分類のための手法.
- ▶ 各入力 x に対して, 事後確率 $\Pr[k \mid X = x]$ が最大になるクラス k をクラスの推定値とする.
- ▶ 各クラス内で, 入力変数は多変量ガウス分布に従うと仮定.
- ▶ 各クラスのクラス内分散が等しいと仮定.
→クラス間の境界が線形になる.
- ▶ 数式で書くと次ページの流れ.

LDA の復習 2 - 定式化と計算

- ▶ 各クラス内の分布はガウス分布と仮定.

$$\Pr[X = x | G = k] = \frac{1}{(2\pi)^{\frac{p}{2}} |\Sigma|^{\frac{1}{2}}} e^{-\frac{1}{2}(x - \mu_k)^T \Sigma^{-1} (x - \mu_k)}$$

- ▶ ベイズの定理より事後確率は以下.

$$\Pr[k | X = x] = \frac{\Pr[X = x | G = k] \Pr[G = k]}{\sum_l \Pr[X = x | G = l] \Pr[G = l]}$$

- ▶ 事後確率の大小比較のため対数比 (log-ratio) を見る.

$$\begin{aligned} \log \frac{\Pr[k | X = x]}{\Pr[l | X = x]} &= \log \frac{\pi_k}{\pi_l} - \frac{1}{2} (\mu_k + \mu_l)^T \Sigma^{-1} (\mu_k - \mu_l) + x^T \Sigma^{-1} (\mu_k - \mu_l) \\ &= (\log \pi_k - \frac{1}{2} \mu_k^T \Sigma^{-1} \mu_k + x^T \Sigma^{-1} \mu_k) \\ &\quad - (\log \pi_l - \frac{1}{2} \mu_l^T \Sigma^{-1} \mu_l + x^T \Sigma^{-1} \mu_l) \end{aligned}$$

- ▶ 結局, 点 x がクラス k である度合い (discriminant score) は以下を評価すれば良い.

$$\delta_k(x) = x^T \Sigma^{-1} \mu_k - \frac{1}{2} \mu_k^T \Sigma^{-1} \mu_k + \log \pi_k$$

Diagonal LDA - 線型判別法の強烈な正則化バージョン

- ▶ 基本的なコンセプトは, 前述の LDA と同じ. 以下の条件を追加する.

$$\Sigma = \text{diag}(s_1, s_2, \dots, s_p) \quad (\text{対角行列})$$

- ▶ すると, discriminant score は, (クラスに依らない定数 $-x^T \Sigma^{-1} x$ を足して 2 倍することで,) 以下になる.

$$\delta_k(x) = - \sum_{j=1}^p \frac{(x_j - \bar{x}_{kj})^2}{s_j^2} + 2 \log \pi_k$$

- ▶ この discriminant score を使って, 以下のルールで分類する.

$$C(x) = \arg \max_l \delta_l(x)$$

Diagonal LDA - 線型判別法の強烈な正則化バージョン

Diagonal LDA について何点か補足.

- ▶ discriminant score は距離に見える.
→ Diagonal LDA は, 適当な標準化をしたデータにおける nearest centroid 法のようにも見える.
- ▶ 変数間の共分散が 0 という仮定を, 独立律 (independent rule) ともいう.
- ▶ 高次元の時には, effective なことが多いらしい.
- ▶ この方法の欠点の一つは, 特徴量選択 (feature selection) ができないこと. 高次元の入力の時には, 一部の変数を選び出せる方法を使いたい.
→ もっと正則化の条件を強めるとパフォーマンスがさらに上がるらしい.
- ▶ 次は, 特徴量選択が行われるような正則化の条件をかけたバージョンを考えます.

Nearest Shrunk Centroids

前出の Diagonal LDA = Nearest Centroid 法の centroid を縮小 (shrinkage) させることで、特徴量選択を行えるようにする。

- ▶ 基本的な計算は、Diagonal LDA と一緒。
- ▶ discriminant score の計算に使う centroid を単純な平均 \bar{x}_{kj} から変える。
- ▶ まず、あるパラメータ X_j のクラス k 内での平均 \bar{x}_{kj} と全体での平均 \bar{x}_j の差を標準化する。

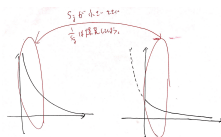
$$d_{kj} = \frac{\bar{x}_{kj} - \bar{x}_j}{m_k(s_j + s_0 b)}$$

ただし、各項は以下。

$$m_k = \frac{1}{N_k} - \frac{1}{N} : \text{疑問点}$$

s_0 = 小さな定数

s_j が小さい時に d_{kj} が大きくなりすぎないように



$$\begin{aligned} & \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N (x_{ij} - \bar{x}_j)^2 \\ & \text{Var}[\bar{x}_{kj} - \bar{x}_j] \\ & = \text{Var}[\bar{x}_{kj}] + \text{Var}[\bar{x}_j] \\ & = \frac{\sigma^2}{N_k} + \text{Var}\left[\frac{\sum_{i=1}^N x_{ij}}{N}\right] \\ & = \frac{\sigma^2}{N_k} + \frac{1}{N^2} \sum_{i=1}^N N_k^2 \text{Var}[x_{ij}] \\ & = \frac{\sigma^2}{N_k} + \frac{1}{N^2} \sum_{i=1}^N N_k^2 \cdot \sigma^2 \\ & = \frac{\sigma^2}{N_k} + \frac{1}{N^2} \cdot \frac{1}{N} \cdot N_k \cdot \sigma^2 \\ & = \left(\frac{1}{N_k} + \frac{1}{N}\right) \sigma^2 \end{aligned}$$

Nearest Shrunken Centroids

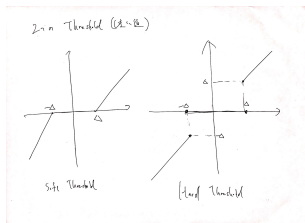
- この標準化された距離を soft-threshold

$$d'_{kj} = \text{sign}(d_{kj})(|d_{kj}| - \Delta)$$

もしくは hard-threshold

$$d'_{kj} = d_{kj} I(|d_{kj}| \geq \Delta)$$

で縮小させる.



- すなわち, 以下.

$$\bar{x}'_{kj} = \bar{x}_j + m_k(s_j + s_0)d'_{jk}$$

寄与の小さい特徴量を見捨てるようになっている.

- Diagonal LDA の discriminant score の \bar{x}_{kj} の代わりに, \bar{x}'_{kj} を使えば, NSC の完成.

Section 3

2 次で正則化した線型分類 p.654-

