

BigData_MachineLearning

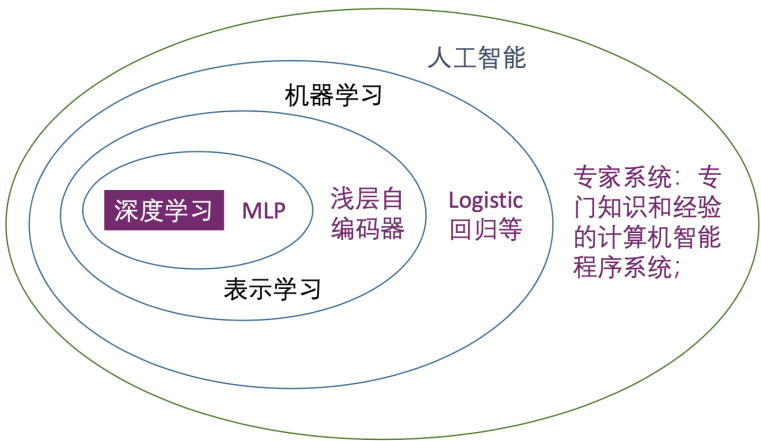
第一章 绪论

机器学习：

机器学习是近20多年兴起的一门多领域交叉学科，涉及概率论、统计学、逼近论、凸分析、算法复杂度理论等多门学科。机器学习理论主要是设计和分析一些让计算机可以自动“学习”的算法。机器学习算法是一类从数据中自动分析获得规律，并利用规律对未知数据进行预测的算法。因为学习算法中涉及了大量的统计学理论，机器学习与统计推断学联系尤为密切，也被称为统计学习理论。

人工智能/机器学习/深度学习

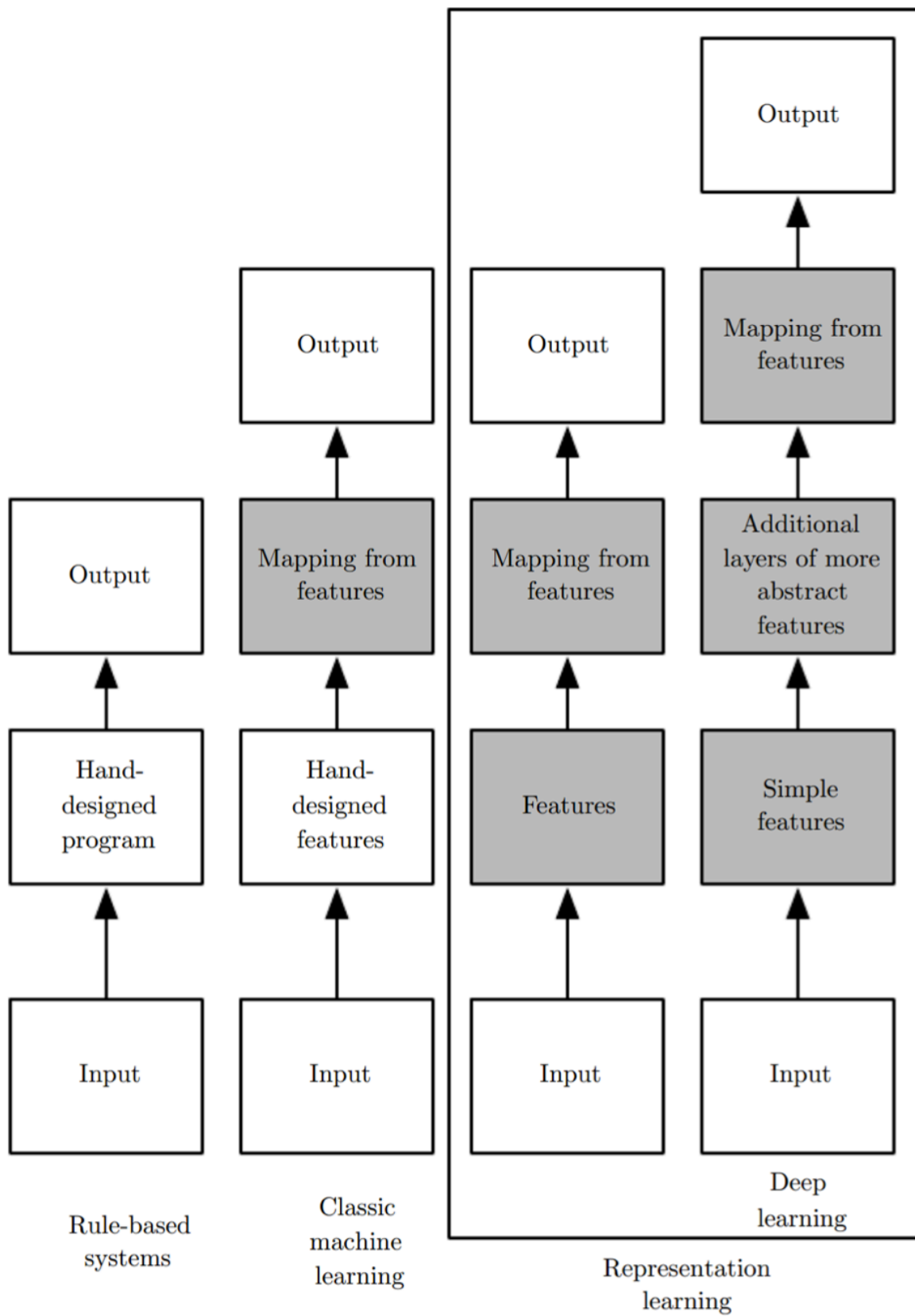
■ 人工智能/机器学习/深度学习



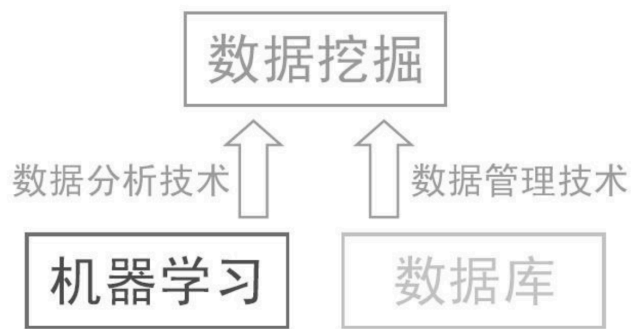
人工智能：是科学，为机器赋予视觉/听觉/触觉/推理等智能。

机器学习：人工智能的计算方法。

深度学习和人工智能其它方法



■ 机器学习和数据挖掘



计算机视觉是机器学习最重要的应用

机器学习和统计学习

- Simon Blomberg:
 - From R's fortunes package: To paraphrase provocatively, 'machine learning is statistics minus any checking of models and assumptions'
- Andrew Gelman:
 - In that case, maybe we should get rid of checking of models and assumptions more often. Then maybe we'd be able to solve some of the problems that the machine learning people can solve but we can't

大数据机器学习的主要特征

- 与日俱增的数据量
- 实验数据量的增加
- 与日俱增的神经网络模型规模
- 与日俱增的精度、复杂度和对现实世界的冲击
- GPU (Graphic Processing Unit)
- TPU Tensor Processing Unit
- 深度学习框架
 - TensorFlow Pytorch Caffe CNTK Keras MXNet Theano Scikit-learning Spark MLlib

第二章 机器学习基本概念

基本术语

- Data set

- 形状=圆形 剥皮=难 味道=酸甜
- 形状=扁圆形 剥皮=易 味道=酸
- 形状=长圆形 剥皮=难 味道=甜
- Instance/sample
- Attribute value/feature
- Attribute/feature space
- Feature vector
- $D = x_1, x_2, \dots, x_m$ m个示例的数据集
- 是d维样本空间X的一个特征向量
- training/learning
- training data
- training sample
- Label ((形状=长圆形 剥皮=难 味道=甜), 橙子)
- example

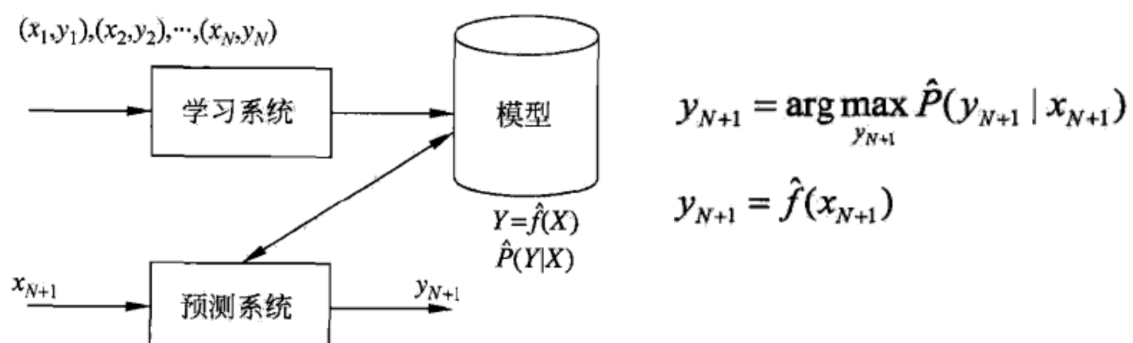
机器学习的任务

- Classification, discrete
- Regression, continuous
- Binary classification, 2-related
- Multi-class classification
- Clustering
- Multi-labeling annotation

监督学习

- 监督学习目的是学习一个由输入到输出的映射，称为模型
- 模型的集合就是假设空间(hypothesis space)
- 模型:
 - 概率模型:条件概率分布 $P(Y|X)$
 - 非概率模型:决策函数 $Y = f(X)$
- 联合概率分布:假设输入与输出的随机变量X和Y遵循联合概率 分布 $P(X,Y)$

问题的形式化



假设空间 hypothesis space

- 学习过程: 搜索所有假设空间, 与训练集匹配
 - 形状=圆形 剥皮=难 味道=酸甜 橙
 - 形状=扁圆形 剥皮=易 味道=酸 橘
 - 形状=长圆形 剥皮=难 味道=甜 橙
- 假设形状, 剥皮, 味道 分别有3, 2, 3 种可能取值, 加上取任意值*和空集, 假设空间规模 $4 \times 3 \times 4 + 1 = 49$
- Version space: 与训练集一致的假设集合
 - 形状=剥皮=难味道= 橙
 - 形状=扁圆形 剥皮=易 味道=* 橘

学习三要素, 方法=模型+策略+算法

模型

- 当假设空间F为决策函数的集合: $F = \{f|Y = f(x)\}$
- F实质为参数向量决定的函数族: $F = \{f|Y = f_{\theta}(x), \theta \in R^n\}$
- 当假设空间F为条件概率的集合: $F = \{P|P(X|Y)\}$
- F实质是参数向量决定的条件概率分布族: $F = \{P|P_{\theta}(Y|X), \theta \in R^n\}$

策略

损失函数和风险函数

- 0-1 loss function, $L(Y, f(x)) = \begin{cases} 1, & Y \neq f(X) \\ 0, & Y = f(X) \end{cases}$
- Quadratic loss function, $L(Y, f(X)) = (Y - f(X))^2$
- Absolute loss function, $L(Y, f(X)) = |Y - f(X)|$
- Logarithmic loss function/loglikelihood loss function, $L(Y, P(Y|X)) = -\log P(Y|X)$

损失函数的期望, 风险函数risk function, 期望损失expected loss

- $R_{exp}(f) = E_p[L(Y, f(X))] = \int_{x \times y} L(y, f(x)) P(x, y) dx dy$

经验风险empirical risk, 经验损失empirical loss

- $T = (x_1, y_1), (x_2, y_2), \dots, (x_N, y_N)$
- $R_{emp}(f) = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N L(y_i, f(x_i))$

因为风险函数很难求, 一般使得经验风险最小化与结构风险最小化

- 经验风险最小化模型, $\min_{f \in F} \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N L(y_i, f(x_i))$
- 当样本容量很小时, 经验风险最小化学习的效果未必很好, 会产生"过拟合over-fitting"
- 为防止过拟合提出的策略, 结构风险最小化 structure risk minimization, 等价于正则化(regularization), 加入正则化项regularizer, 或罚项 penalty term
 - $R_{emp}(f) = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N L(y_i, f(x_i)) + \lambda J(f)$

方法

求最优模型就是求解最优化问题:

- $\min_{f \in F} \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N L(y_i, f(x_i)) + \lambda J(f)$
- 难点
 - 全剧最优
 - 高校

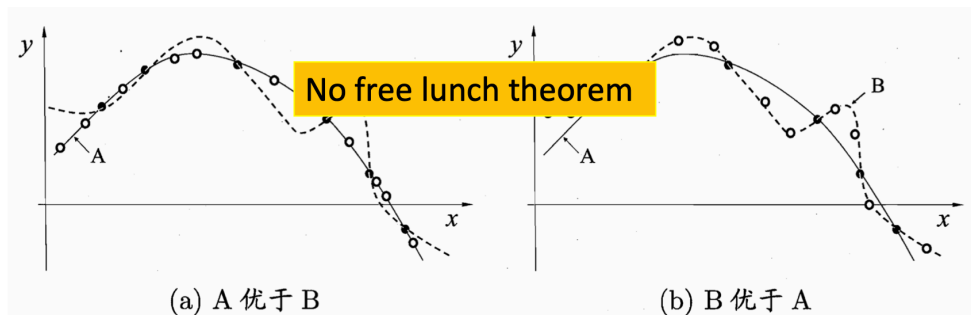
奥卡姆剃刀原理 Occam's razor

“如无必要，勿增实体”

• 疑问一：哪个更简单？

- 形状=* 剥皮=难 味道=* 橙
- 形状=长圆形 剥皮=* 味道=* 橙

• 疑问二：



No free lunch theorem

• 二分类问题： 总误差竟然与学习算法无关

$$\begin{aligned} \sum_f E_{ote}(\mathcal{L}_a | X, f) &= \sum_f \sum_h \sum_{x \in \mathcal{X} - X} P(x) \mathbb{I}(h(x) \neq f(x)) P(h | X, \mathcal{L}_a) \\ &= \sum_{x \in \mathcal{X} - X} P(x) \sum_h P(h | X, \mathcal{L}_a) \sum_f \mathbb{I}(h(x) \neq f(x)) \\ &= \sum_{x \in \mathcal{X} - X} P(x) \sum_h P(h | X, \mathcal{L}_a) \frac{1}{2} 2^{|\mathcal{X}|} \\ &= \frac{1}{2} 2^{|\mathcal{X}|} \sum_{x \in \mathcal{X} - X} P(x) \sum_h P(h | X, \mathcal{L}_a) \\ &= 2^{|\mathcal{X}|-1} \sum_{x \in \mathcal{X} - X} P(x) \cdot 1 \end{aligned}$$

- N F L 定理前提条件:
 - 所有“问题”出现的机会相同, 或所有问题同等重要
 - 假设真实函数 f 的均匀分布。

- 形状= * 剥皮=难 味道=* 橙
- 形状=长圆形 剥皮=* 味道=* 橙

- N F L 寓意: 脱离具体问题, 空谈“什么方法好”毫无意义。

训练误差和测试误差

训练误差, 训练数据集的平均损失: $R_{emp}(\hat{f}) = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N L(y_i, f(\hat{x}_i))$

测试误差, 测试数据集的平均损失: $e_{test} = \frac{1}{N'} \sum_{i=1}^{N'} L(y_i, f(\hat{x}_i))$

损失函数是0-1损失时: $e_{test} = \frac{1}{N'} \sum_{i=1}^{N'} L(y_i \neq f(\hat{x}_i))$

测试数据集的准确率: $r_{test} = \frac{1}{N'} \sum_{i=1}^{N'} L(y_i = f(\hat{x}_i))$

$$e_{test} + r_{test} = 1$$

过拟合

- 过拟合与模型选择-多项式曲线拟合的例子
- 假设给定训练数据集

- 假设给定训练数据集

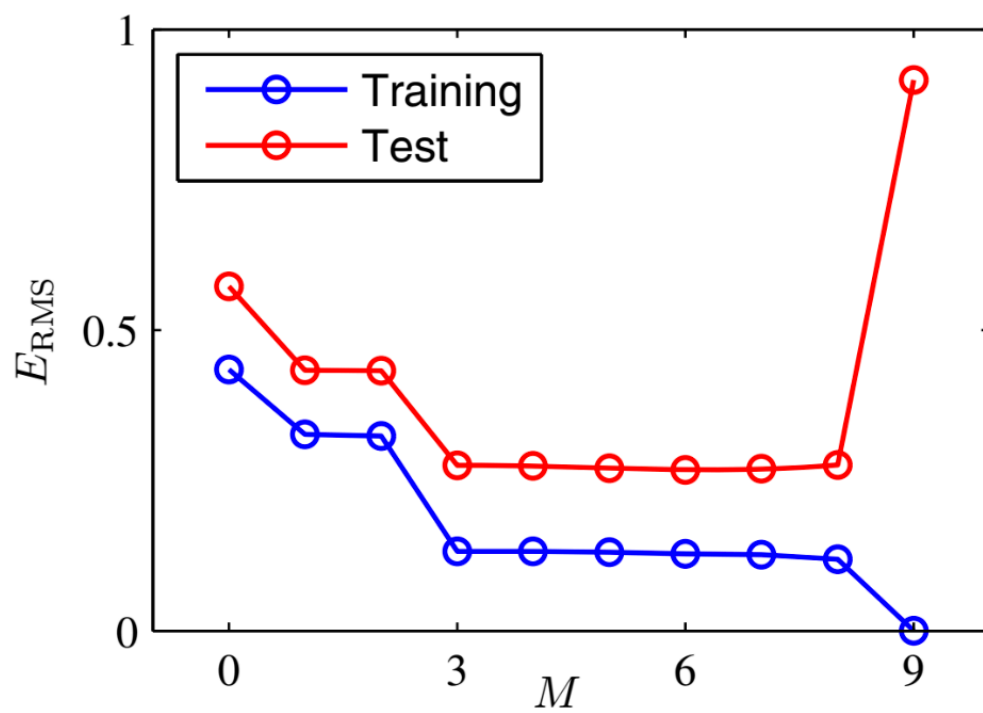
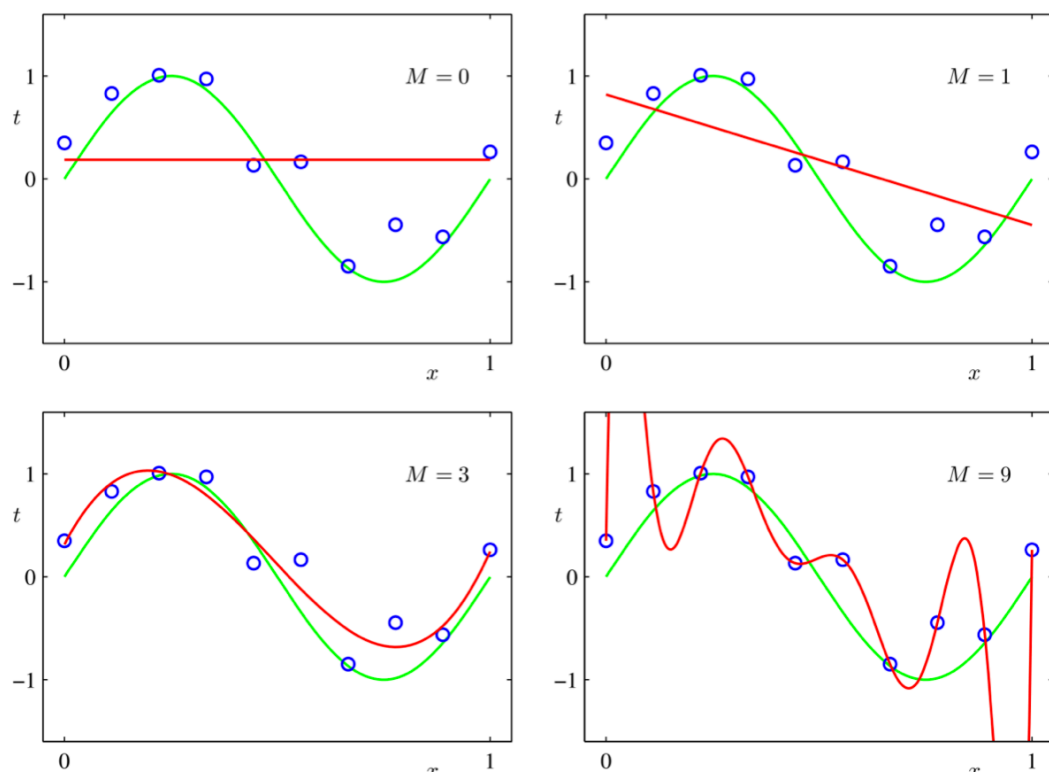
$$T = \{(x_1, y_1), (x_2, y_2), \dots, (x_N, y_N)\}$$

$$f_M(x, w) = w_0 + w_1 x + w_2 x^2 + \dots + w_M x^M = \sum_{j=0}^M w_j x^j$$

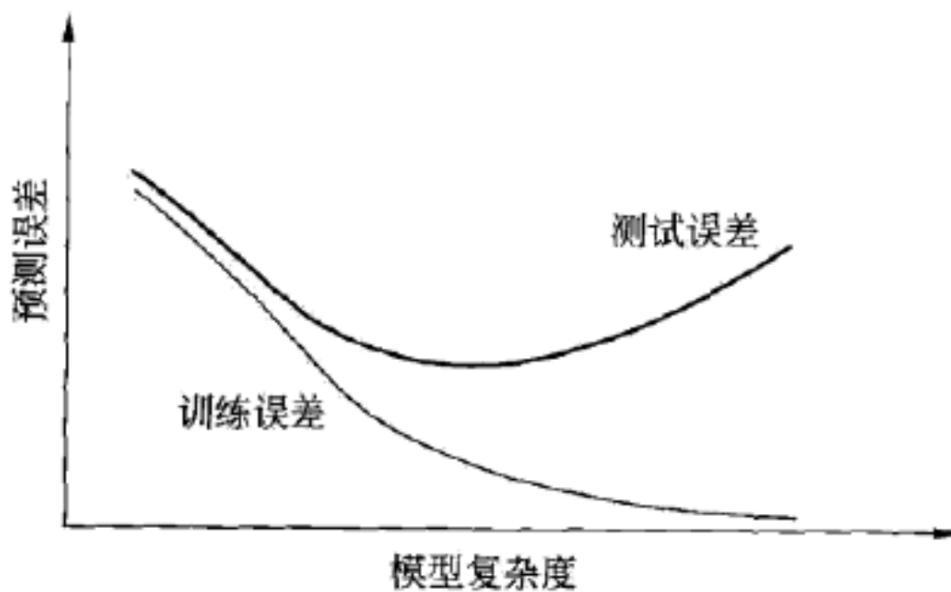
- 经验风险最小:

$$L(w) = \frac{1}{2} \sum_{i=1}^N (f(x_i, w) - y_i)^2 \quad L(w) = \frac{1}{2} \sum_{i=1}^N \left(\sum_{j=0}^M w_j x_i^j - y_i \right)^2$$

$$w_j = \frac{\sum_{i=1}^N x_i y_i}{\sum_{i=1}^N x_i^{j+1}}, \quad j = 0, 1, 2, \dots, M$$

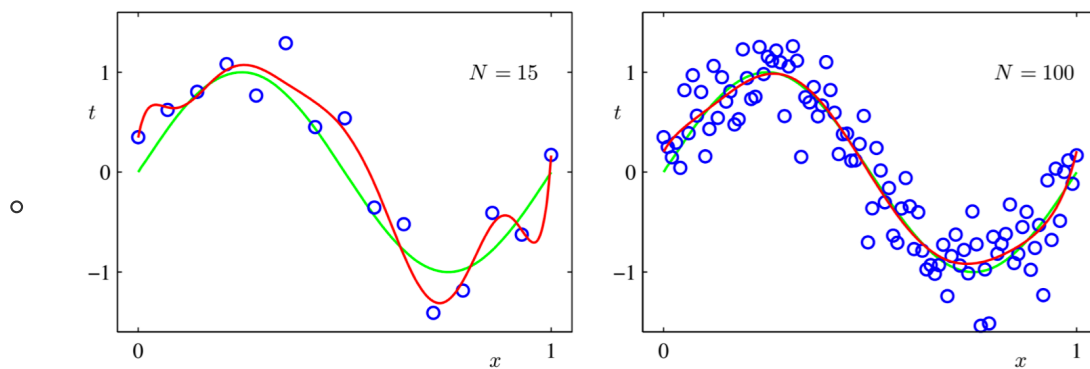


$M = 9$ 为过拟合



解决方法：

- 增大训练样本集



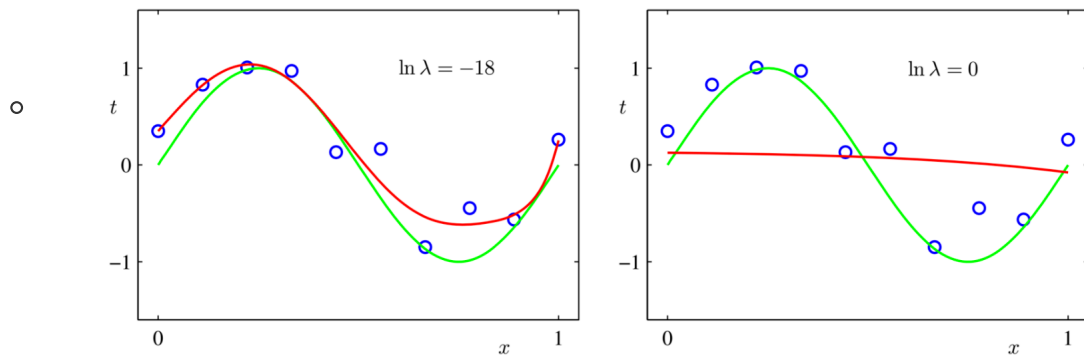
- 正则化

• 正则化一般形式：
$$\min_{f \in \mathcal{F}} \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N L(y_i, f(x_i)) + \lambda J(f)$$

• 回归问题中：
$$L(w) = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N (f(x_i; w) - y_i)^2 + \frac{\lambda}{2} \|w\|^2$$

$$L(w) = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N (f(x_i; w) - y_i)^2 + \lambda \|w\|_1$$

$$\tilde{E}(\mathbf{w}) = \frac{1}{2} \sum_{n=1}^N \{y(x_n, \mathbf{w}) - t_n\}^2 + \frac{\lambda}{2} \|\mathbf{w}\|^2$$



- λ 抑制模型复杂化

泛化能力 generalization ability

- 泛化误差 generalization error

$$R_{\text{exp}}(\hat{f}) = E_P[L(Y, \hat{f}(X))] = \int_{\mathcal{X} \times \mathcal{Y}} L(y, \hat{f}(x)) P(x, y) dx dy$$

- 泛化误差上界

- 比较学习方法的泛化能力-----比较泛化误差上界
- 性质：样本容量增加，泛化误差趋于0
- 假设空间容量越大，泛化误差越大

- 二分类问题

$$X \in \mathbf{R}^n, Y \in \{-1, +1\}$$

- 期望风险和经验风险

$$R(f) = E[L(Y, f(X))]$$

- 假设空间F为有限集合

$$\hat{R}(f) = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N L(y_i, f(x_i))$$

- 经验风险最小化函数： $f_N = \arg \min_{f \in \mathcal{F}} \hat{R}(f)$

- 泛化能力：

$$R(f_N) = E[L(Y, f_N(X))]$$

- 定理：泛化误差上界，二分类问题，当假设空间是有限个函数的结合 $\mathcal{F} = \{f_1, f_2, \dots, f_d\}$ 对任意一个函数f，至少以概率 $1 - \delta$ ，以下不等式成立：

$$R(f) \leq \hat{R}(f) + \epsilon(d, N, \delta)$$

$$\epsilon(d, N, \delta) = \sqrt{\frac{1}{2N} \left(\log d + \log \frac{1}{\delta} \right)}$$

d 为假设空间

生成模型与判别模型

- 监督学习的目的就是学习一个模型:
- 决策函数: $Y = f(X)$
- 条件概率分布: $P(Y|X)$
 - 生成方法Generative approach 对应生成模型: generative model,
 - 朴素贝叶斯法和隐马尔科夫模型
 - 判别方法discriminative approach 对应判别模型: discriminative model
 - K近邻, 感知机, 决策树, logistic 回归等

• 二者各有优缺点

• 生成模型:

- 还原联合概率, 而判别模型不能;
- 学习收敛速度快, 当样本容量增加时, 学到的模型可以更快收敛;
- 当存在隐变量时, 可以使用生成模型, 而判别模型不行。

• 判别模型:

- 直接学习决策函数或条件概率, 学习的准确率更高;
- 可以对数据进行抽象, 定义特征和使用特征, 可以简化学习问题。