

# LDA

(latent Dirichlet allocation)

正田 備也

[masada@rikkyo.ac.jp](mailto:masada@rikkyo.ac.jp)

# Contents

PLSA の復習

PLSA の問題点

LDA の変分ベイズ法

# PLSA (probabilistic latent semantic analysis)

- ▶ 同じ文書内でも、異なる単語トークンは異なる単語多項分布から生成されうる（＝異なるトピックを表現しうる）
- ▶ 文書によって、各トピックの出現確率が異なる
- ▶ PLSA では、単語多項分布をトピック (topic) と呼ぶ
- ▶ PLSA は最もシンプルなトピックモデル
  - ▶ トピックモデルは、単語トークンの “クラスタリング”
  - ▶ 同一文書内の同一単語の異なるトークンは区別されない (bag-of-words)

# Notations

- ▶ 語彙集合  $\{1, \dots, W\}$
- ▶ トピック集合  $\{1, \dots, K\}$ 
  - ▶ 語彙やトピックをその添字と同一視している。
- ▶ 文書集合  $\mathcal{X} = \{\mathbf{x}_1, \dots, \mathbf{x}_N\}$
- ▶ 文書  $\mathbf{x}_i$  の  $j$  番目のトークンとして現れる単語を、 $x_{i,j}$  という確率変数で表す
- ▶ 文書  $\mathbf{x}_i$  の  $j$  番目の単語  $x_{i,j}$  が表現するトピックを、 $z_{i,j}$  という確率変数で表す
- ▶  $x_{i,j}$  の値は観測されているが、 $z_{i,j}$  の値は観測されていない
  - ▶ つまり、 $z_{i,j}$  は潜在変数。

# PLSAにおける同時分布

- ▶ PLSA では、文書  $x_i$  の  $j$  番目のトークンがトピック  $k$  を表現し、かつそのトピックを表現するために単語  $w$  が使われる同時確率、つまり  $p(x_{i,j} = w, z_{i,j} = k)$  は

$$p(x_{i,j} = w, z_{i,j} = k) = p(z_{i,j} = k)p(x_{i,j} = w|z_{i,j} = k) \quad (1)$$

- ▶  $p(z_{i,j} = k)$  は、文書  $x_i$  の  $j$  番目のトークンが（他のトピックでなく）トピック  $k$  を表現する確率
- ▶  $p(x_{i,j} = w|z_{i,j} = k)$  は、文書  $x_i$  の  $j$  番目のトークンがトピック  $k$  を表現するとき（他の単語でなく）単語  $w$  が使われる確率
- ▶ さらに、PLSA では以下のように仮定する（次スライド）

# PLSAにおいて仮定すること

- ▶ どの  $j, j'$  についても  $p(z_{i,j} = k) = p(z_{i,j'} = k)$  と仮定
  - ▶ 同じ文書内なら、どの単語トークンであれ、トピック  $k$  を表現する確率は、同じ（場所によってトピックの確率が違ったりしない）
  - ▶ そこで、 $p(z_{i,\cdot} = k) = \theta_{i,k}$  とおく
- ▶ どの  $i, i'$  と  $j, j'$  についても、 $p(x_{i,j} = w | z_{i,j} = k) = p(x_{i',j'} = w | z_{i',j'} = k)$  と仮定
  - ▶ 同じコーパス内なら、どの文書のどの単語トークンであれ、それがトピック  $k$  を表現するために使われるならば（条件付き確率の条件の部分）、 $k$  を表現するためにどの単語が使われるかの確率は、同じ
  - ▶ つまり、単語確率分布とトピックが一对一に対応している
  - ▶ そこで、 $p(x_{\cdot,j} = w | z_{\cdot,j} = k) = \phi_{k,w}$  とおく

# PLSAにおける観測データの尤度

個々の単語トークンにおけるトピックと単語の同時分布は

$$p(x_{i,j} = w, z_{i,j} = k) = p(z_{i,j} = k)p(x_{i,j} = w|z_{i,j} = k) = \theta_{i,k}\phi_{k,x_{i,j}} \quad (2)$$

潜在変数である  $z_{i,j}$  を周辺化

$$p(x_{i,j} = w) = \sum_{z_{i,j}=1}^K p(x_{i,j} = w, z_{i,j} = k) = \sum_{k=1}^K \theta_{i,k}\phi_{k,x_{i,j}} \quad (3)$$

各トークンの独立性の仮定より

$$p(\mathbf{x}_i) = \prod_{j=1}^{n_i} p(x_{i,j}) = \prod_{j=1}^{n_i} \left( \sum_{k=1}^K \theta_{i,k}\phi_{k,x_{i,j}} \right) \quad (4)$$

各文書の独立性の仮定より

$$p(\mathcal{X}) = \prod_{i=1}^N p(\mathbf{x}_i) = \prod_{i=1}^N \prod_{j=1}^{n_i} \left( \sum_{k=1}^K \theta_{i,k}\phi_{k,x_{i,j}} \right) \quad (5)$$

# Contents

PLSA の復習

PLSA の問題点

LDA の変分ベイズ法



# PLSAの問題点とベイズ化による改良

- ▶ 各文書におけるトピック確率  $\theta_i = (\theta_{i,1}, \dots, \theta_{i,K})$  に関して、異なる文書の間で何の関係性も仮定されていない
  - ▶  $\theta_i$  と  $\theta_{i'}$  の間に何の関係もない。
- ▶ このことが過学習をもたらすかもしれない
- ▶ そこで、コーパスに属する全文書の  $\theta_i$  が、同一のディリクレ事前分布  $\text{Dir}(\alpha)$  から draw されると仮定する
- ▶ 他はPLSAのまま
  - ▶ 各トピックの単語確率  $\phi_k$  についても別のディリクレ分布  $\text{Dir}(\beta)$  を導入できるが、そうしなくてもよい

# PLSA と LDA の比較

PLSA における  $x_i$  の尤度

$$\begin{aligned} p(x_i; \theta_i, \Phi) &= \sum_{z_i} p(x_i, z_i; \theta_i, \Phi) = \sum_{z_i} p(z_i; \theta_i) p(x_i | z_i; \Phi) \\ &= \prod_{j=1}^{n_i} \left( \sum_{z_{i,j}=1}^K p(z_{i,j}; \theta_i) p(x_{i,j} | z_{i,j}; \Phi) \right) = \prod_{j=1}^{n_i} \left( \sum_{k=1}^K \theta_{i,k} \phi_{k,x_{i,j}} \right) \end{aligned}$$

LDA における  $x_i$  の尤度 ( $p(x_i; \theta_i, \Phi)$  は  $p(x_i | \theta_i; \Phi)$  に変わる)

$$\begin{aligned} p(x_i; \Phi, \alpha) &= \int p(\theta_i; \alpha) p(x_i | \theta_i; \Phi) d\theta_i \\ &= \int \sum_{z_i} p(\theta_i; \alpha) p(z_i | \theta_i) p(x_i | z_i; \Phi) d\theta_i \\ &= \int \left( \frac{\Gamma(\sum_k \alpha_k)}{\prod_k \Gamma(\alpha_k)} \prod_{k=1}^K \theta_k^{\alpha_k - 1} \right) \prod_{j=1}^{n_i} \left( \sum_{k=1}^K \theta_{i,k} \phi_{k,x_{i,j}} \right) d\theta_i \quad (6) \end{aligned}$$

# Contents

PLSA の復習

PLSA の問題点

LDA の変分ベイズ法

# LDAの変分ベイズ法

Jensen の不等式を適用して ELBO を求める

$$\begin{aligned}\ln p(\mathbf{x}_i; \Phi, \alpha) &= \ln \int \sum_{\mathbf{z}_i} p(\boldsymbol{\theta}_i; \alpha) p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) p(\mathbf{x}_i | \mathbf{z}_i; \Phi) d\boldsymbol{\theta}_i \\ &= \ln \int \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i, \boldsymbol{\theta}_i) \frac{p(\boldsymbol{\theta}_i; \alpha) p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) p(\mathbf{x}_i | \mathbf{z}_i; \Phi)}{q(\mathbf{z}_i, \boldsymbol{\theta}_i)} d\boldsymbol{\theta}_i \\ &\geq \int \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i, \boldsymbol{\theta}_i) \ln \frac{p(\boldsymbol{\theta}_i; \alpha) p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) p(\mathbf{x}_i | \mathbf{z}_i; \Phi)}{q(\mathbf{z}_i, \boldsymbol{\theta}_i)} d\boldsymbol{\theta}_i\end{aligned}\tag{7}$$

以下、 $q(\mathbf{z}_i, \boldsymbol{\theta}_i) = q(\mathbf{z}_i)q(\boldsymbol{\theta}_i)$  と factorize すると仮定する。

## $q(\boldsymbol{\theta}_i)$ を求める

$q(\mathbf{z}_i)$  を固定する。

$$\begin{aligned}\ln p(\mathbf{x}_i; \Phi, \alpha) &\geq \int \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) q(\boldsymbol{\theta}_i) \ln \frac{p(\boldsymbol{\theta}_i; \alpha) p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) p(\mathbf{x}_i | \mathbf{z}_i; \Phi)}{q(\mathbf{z}_i) q(\boldsymbol{\theta}_i)} d\boldsymbol{\theta}_i \\ &= \int q(\boldsymbol{\theta}_i) \left[ \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) \ln p(\boldsymbol{\theta}_i; \alpha) p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) \right] d\boldsymbol{\theta}_i - \int q(\boldsymbol{\theta}_i) \ln q(\boldsymbol{\theta}_i) d\boldsymbol{\theta}_i + \text{const.} \\ &= -D_{\text{KL}}(q(\boldsymbol{\theta}_i) \parallel \frac{1}{Z} \exp \left[ \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) \ln p(\boldsymbol{\theta}_i; \alpha) p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) \right]) + \text{const.}\end{aligned}\tag{8}$$

以上より、 $q(\boldsymbol{\theta}_i) \propto \exp \left[ \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) \ln p(\boldsymbol{\theta}_i; \alpha) p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) \right]$  のとき、ELBO は最大。つまり、 $q(\boldsymbol{\theta}_i) \propto p(\boldsymbol{\theta}_i; \alpha) \exp \left[ \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) \ln p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) \right]$  のとき、ELBO は最大。

$$\begin{aligned}
\sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) \ln p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) &= \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) \ln \prod_{j=1}^{n_i} \theta_{i, z_{i,j}} = \sum_{j=1}^{n_i} \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) \ln \theta_{i, z_{i,j}} \\
&= \sum_{j=1}^{n_i} \sum_{z_{i,j}=1}^K q(z_{i,j}) \ln \theta_{i, z_{i,j}} = \sum_{k=1}^K \left( \sum_{j=1}^{n_i} q(z_{i,j} = k) \right) \ln \theta_{i,k} = \sum_{k=1}^K n_{i,k} \ln \theta_{i,k} \quad (9)
\end{aligned}$$

ただし、 $n_{i,k} \equiv \sum_{j=1}^{n_i} q(z_{i,j} = k)$  と定義した。よって

$$\begin{aligned}
q(\boldsymbol{\theta}_i) &\propto \prod_{k=1}^K \theta_{i,k}^{\alpha_k - 1} \times \exp \left[ \sum_{k=1}^K n_{i,k} \ln \theta_{i,k} \right] \\
&= \prod_{k=1}^K \theta_{i,k}^{\alpha_k + n_{i,k} - 1} \quad (10)
\end{aligned}$$

これは、変分事後分布  $q(\boldsymbol{\theta}_i)$  がディリクレ分布であることを意味する。

変分ディリクレ事後分布  $q(\boldsymbol{\theta}_i)$  のパラメータを  $\zeta_i$  とすると、 $\zeta_{i,k} = \alpha_k + n_{i,k}$  が成り立つ。

## $q(z_i)$ を求める

今度は  $q(\theta_i)$  を固定する。

$$\begin{aligned}\ln p(\mathbf{x}_i; \Phi, \alpha) &\geq \int \sum_{z_i} q(z_i) q(\theta_i) \ln \frac{p(\theta_i; \alpha) p(z_i | \theta_i) p(\mathbf{x}_i | z_i; \Phi)}{q(z_i) q(\theta_i)} d\theta_i \\ &= \sum_{z_i} q(z_i) \left[ \ln p(\mathbf{x}_i | z_i; \Phi) + \int q(\theta_i) \ln p(z_i | \theta_i) d\theta_i \right] - \sum_{z_i} q(z_i) \ln q(z_i) + \text{const.} \\ &= -D_{\text{KL}}(q(z_i) \parallel \frac{1}{Z} \exp \left[ \ln p(\mathbf{x}_i | z_i; \Phi) + \int q(\theta_i) \ln p(z_i | \theta_i) d\theta_i \right]) + \text{const.} \quad (11)\end{aligned}$$

以上より、 $q(z_i) \propto p(\mathbf{x}_i | z_i; \Phi) \exp \left[ \int q(\theta_i) \ln p(z_i | \theta_i) d\theta_i \right]$  のとき、ELBO は最大。

変分ディリクレ事後分布  $q(\boldsymbol{\theta}_i)$  のパラメータが  $\zeta_i$  であることを使うと、

$$\begin{aligned} \int q(\boldsymbol{\theta}_i; \zeta_i) \ln p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) d\boldsymbol{\theta}_i &= \int q(\boldsymbol{\theta}_i; \zeta_i) \ln \prod_{j=1}^{n_i} \theta_{i,z_{i,j}} d\boldsymbol{\theta}_i = \sum_{j=1}^{n_i} \int q(\boldsymbol{\theta}_i; \zeta_i) \ln \theta_{i,z_{i,j}} d\boldsymbol{\theta}_i \\ &= \sum_{j=1}^{n_i} \left\{ \psi(\zeta_{i,z_{i,j}}) - \psi\left(\sum_k \zeta_{i,k}\right) \right\} = \sum_{j=1}^{n_i} \psi(\zeta_{i,z_{i,j}}) + \text{const.} \end{aligned} \quad (12)$$

よって、

$$\begin{aligned} q(\mathbf{z}_i) &\propto p(\mathbf{x}_i | \mathbf{z}_i; \boldsymbol{\Phi}) \exp \left[ \int q(\boldsymbol{\theta}_i) \ln p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) d\boldsymbol{\theta}_i \right] = \prod_{j=1}^{n_i} \phi_{z_{i,j}, x_{i,j}} \times \exp \left( \sum_{j=1}^{n_i} \psi(\zeta_{i,z_{i,j}}) \right) \\ &= \prod_{j=1}^{n_i} \phi_{z_{i,j}, x_{i,j}} \times \prod_{j=1}^{n_i} \exp(\psi(\zeta_{i,z_{i,j}})) = \prod_{j=1}^{n_i} \phi_{z_{i,j}, x_{i,j}} \exp(\psi(\zeta_{i,z_{i,j}})) \end{aligned} \quad (13)$$

つまり、

$$q(z_{i,j} = k) = \frac{\phi_{k, x_{i,j}} \exp(\psi(\zeta_{i,k}))}{\sum_{l=1}^K \phi_{l, x_{i,j}} \exp(\psi(\zeta_{i,l}))} \quad (14)$$



# 変分事後分布を使ってELBOを書き下す

$$\begin{aligned}\ln p(\mathbf{x}_i; \Phi, \alpha) &\geq \int \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) q(\boldsymbol{\theta}_i) \ln \frac{p(\boldsymbol{\theta}_i; \alpha) p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) p(\mathbf{x}_i | \mathbf{z}_i; \Phi)}{q(\mathbf{z}_i) q(\boldsymbol{\theta}_i)} d\boldsymbol{\theta}_i \\ &= \int \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) q(\boldsymbol{\theta}_i) \ln p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) d\boldsymbol{\theta}_i + \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) \ln p(\mathbf{x}_i | \mathbf{z}_i; \Phi) \\ &\quad - D_{\text{KL}}(q(\boldsymbol{\theta}_i) \parallel p(\boldsymbol{\theta}_i; \alpha)) - \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) \ln q(\mathbf{z}_i)\end{aligned}\tag{15}$$

式 (15) の右辺の最初の項を計算してみる。

$$\begin{aligned}\int \sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) q(\boldsymbol{\theta}_i) \ln p(\mathbf{z}_i | \boldsymbol{\theta}_i) d\boldsymbol{\theta}_i &= \sum_{j=1}^{n_i} \sum_{\mathbf{z}_{i,j}=1}^K q(\mathbf{z}_{i,j}) \int q(\boldsymbol{\theta}_i) \ln \theta_{i,\mathbf{z}_{i,j}} d\boldsymbol{\theta}_i \\ &= \sum_{k=1}^K \left( \sum_{j=1}^{n_i} q(\mathbf{z}_{i,j} = k) \right) \left( \psi(\zeta_{i,k}) - \psi\left(\sum_l \zeta_{i,l}\right) \right)\end{aligned}\tag{16}$$

式 (15) の右辺の 2 番目の項を計算してみる。

$$\sum_{\mathbf{z}_i} q(\mathbf{z}_i) \ln p(\mathbf{x}_i | \mathbf{z}_i; \Phi) = \sum_{j=1}^{n_i} \sum_{\mathbf{z}_{i,j}=1}^K q(z_{i,j}) \ln \phi_{z_{i,j}, x_{i,j}} = \sum_{j=1}^{n_i} \sum_{k=1}^K q(z_{i,j} = k) \ln \phi_{k, x_{i,j}} \quad (17)$$

トピック単語確率  $\Phi$  は、この項の全文書についての和  $\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^{n_i} \sum_{k=1}^K q(z_{i,j} = k) \ln \phi_{k, x_{i,j}}$  を最大化することで求めることができる。(ELBO の中で  $\Phi$  を含むのはこの項だけだから。) 全文書の ELBO の和を  $\mathcal{L}$  と書くことにする。

$\sum_{w=1}^W \phi_{k,w} = 1$  が満たされなければならないので、ラグランジュの未定乗数法を使えば、

$$\frac{\partial \mathcal{L}}{\partial \phi_{k,w}} + \frac{\partial}{\partial \phi_{k,w}} \lambda_k \left( 1 - \sum_{w=1}^W \phi_{k,w} \right) = \frac{\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^{n_i} q(z_{i,j} = k) \delta(x_{i,j} = w)}{\phi_{k,w}} - \lambda_k \quad (18)$$

$$\therefore \phi_{k,w} = \frac{\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^{n_i} q(z_{i,j} = k) \delta(x_{i,j} = w)}{\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^{n_i} q(z_{i,j} = k)} \quad (19)$$

# LDAの変分ベイズ法のまとめ

以下の更新を繰り返し実行する。

$$q(z_{i,j} = k) \leftarrow \frac{\phi_{k,x_{i,j}} \exp(\psi(\zeta_{i,k}))}{\sum_{l=1}^K \phi_{l,x_{i,j}} \exp(\psi(\zeta_{i,l}))} \quad (20)$$

$$\zeta_{i,k} \leftarrow \alpha_k + \sum_{j=1}^{n_i} q(z_{i,j} = k) \quad (21)$$

$$\phi_{k,w} \leftarrow \frac{\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^{n_i} q(z_{i,j} = k) \delta(x_{i,j} = w)}{\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^{n_i} q(z_{i,j} = k)} \quad (22)$$

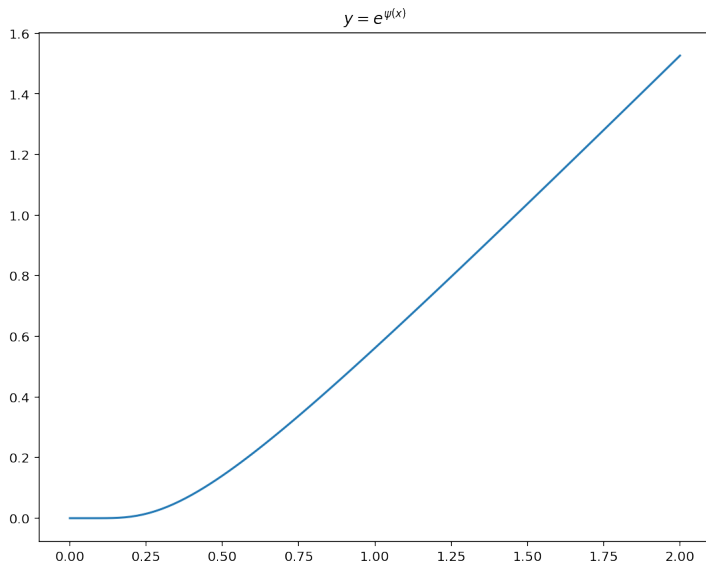


Figure:  $y = e^{\psi(x)}$  のグラフ