

机器学习

xbZhong

2024-02-18

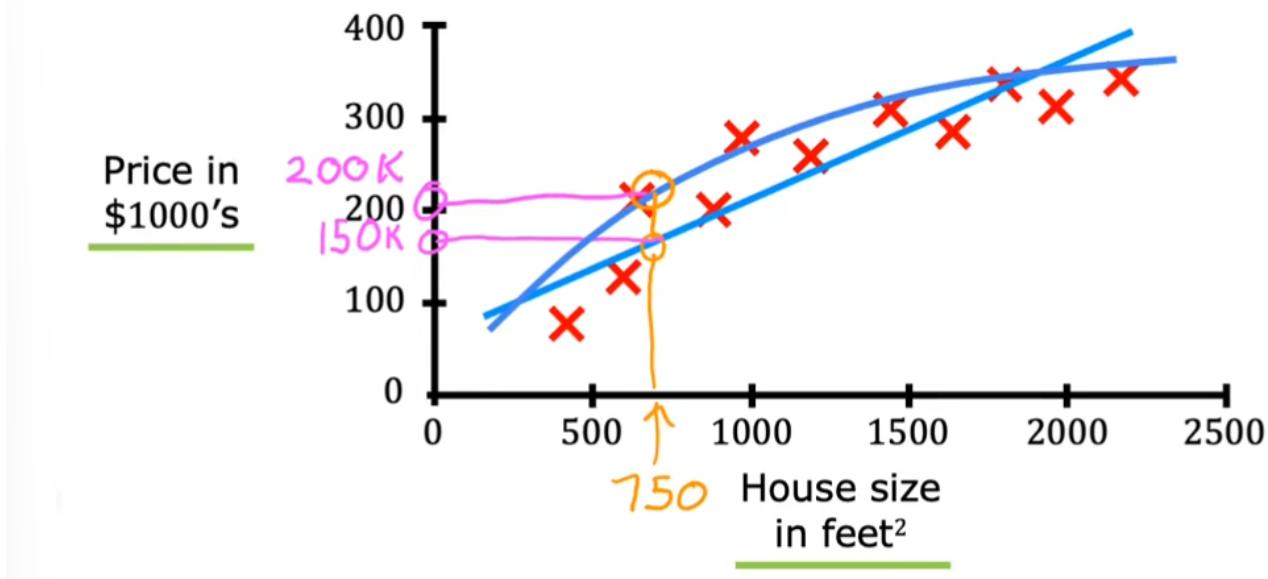
[本页PDF](#)

机器学习

监督学习 (Supervised learning)

指的是学习x到y或输入到输出映射的算法 关键特征：提供学习算法示例以供学习 ##### 回归

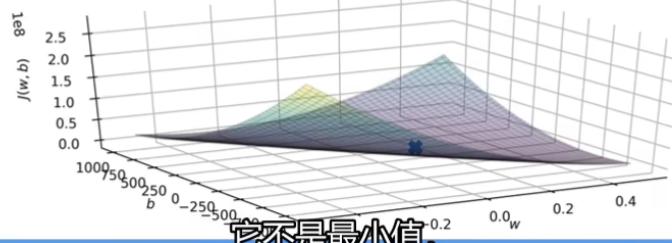
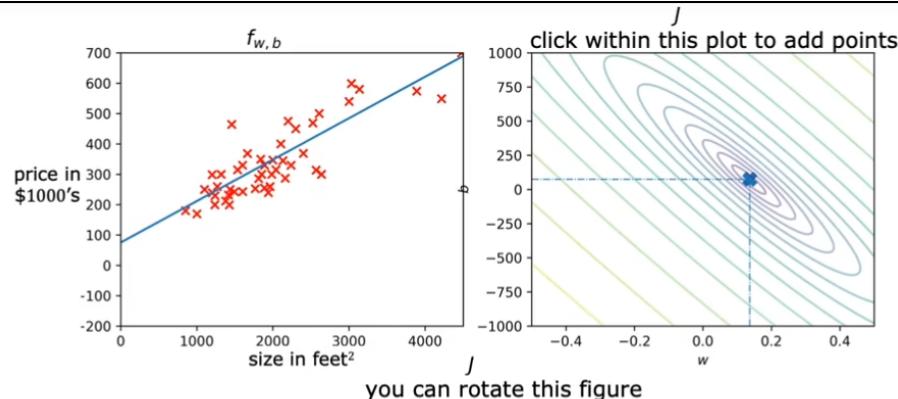
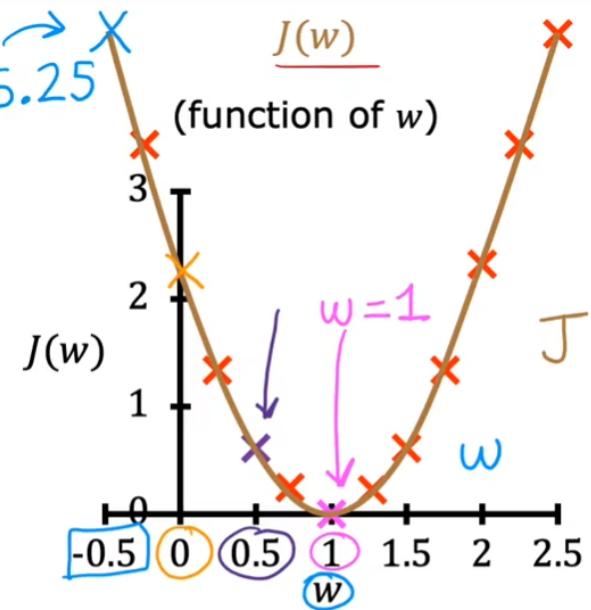
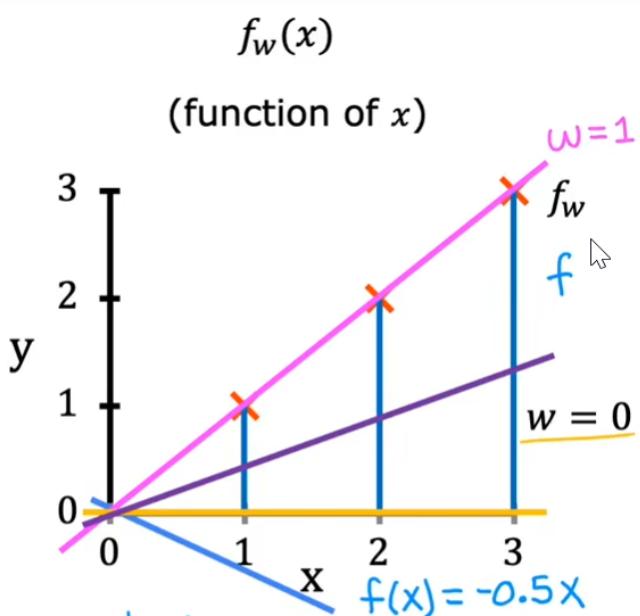
Regression: Housing price prediction



* 拟合曲线或更复杂的函数 * 指的是通过建立数学模型(算法)来对因变量进行分析，算法预测的结果是无数可能值中的一个 * 其学习从无限多的可能数字中预测数字

线性回归模型

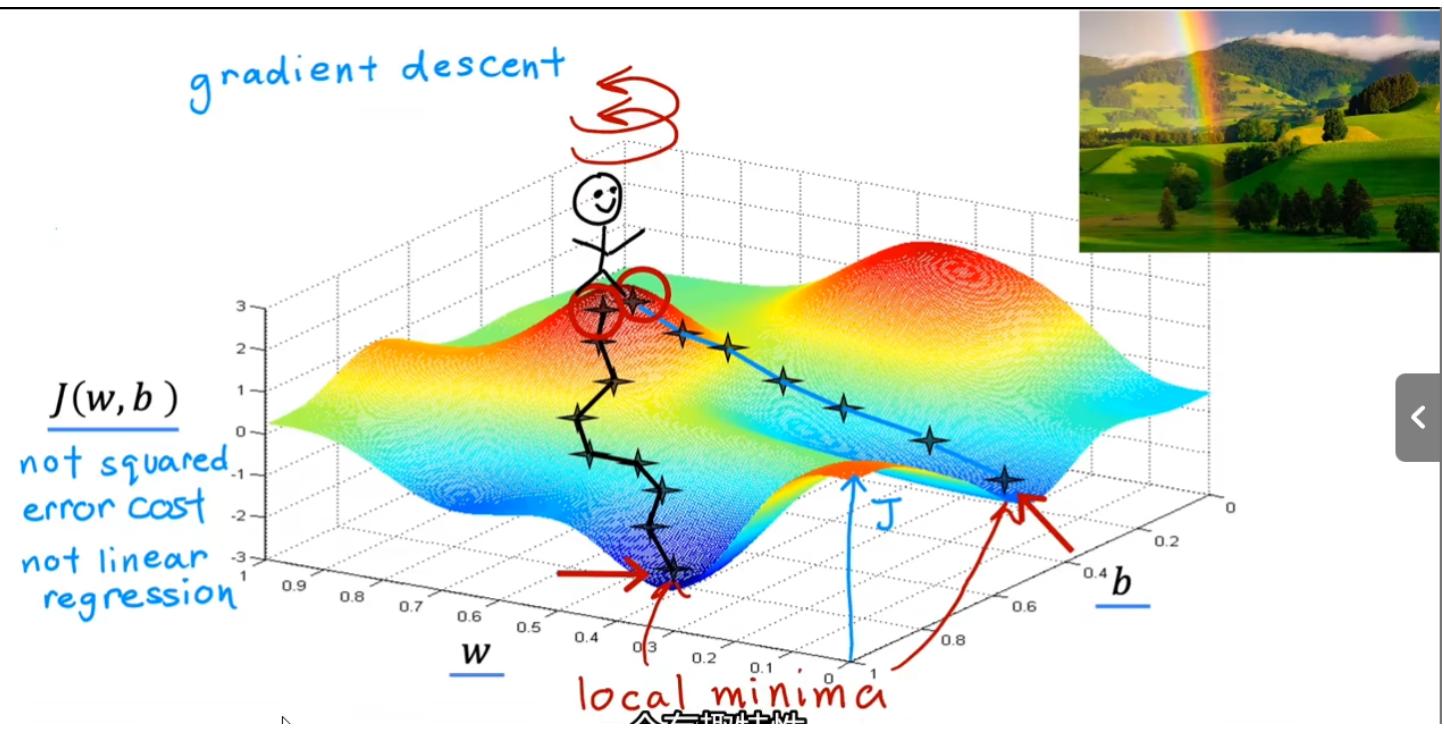
- 根据数据进行模型训练，然后根据数据拟合成一条直线
- 字母仅仅是 y 时，表明是训练集中的真实值；是 \hat{y} 则是模型的预测值
- $f(x) = wx + b$ ##### 成本函数
- 成本函数（平方误差成本函数）： $J = \frac{\sum_{i=1}^m (\hat{y}^{(i)} - y^{(i)})^2}{2m}$
- 成本函数是w和b的函数,取斜率为0的切线的那个切点即为极小值，使得成本函数最小



alt text

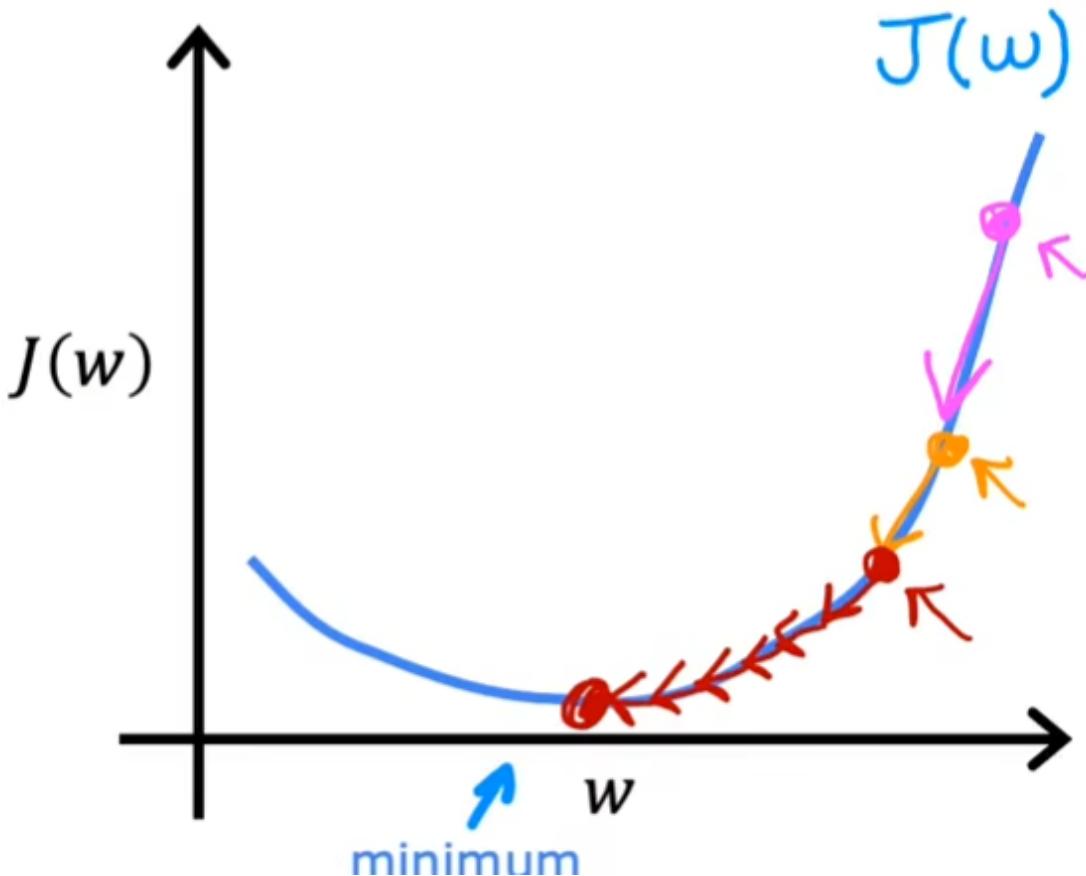
梯度下降

- 其是一种可用于尝试最小化任何函数的算法，适用于具有两个以上参数的模型



* 梯度下降会用最快的方式把自己带到局部最小值，但局部最小值不一定相同，因为参数初始化的不同会让自己站在不同的位置，从而使得选择路线发生变化 ##### 梯度下降算法 $w = w - \alpha \frac{\partial}{\partial w} J(w, b)$ $b = b - \alpha \frac{\partial}{\partial b} J(w, b)$ * 当 α (学习率)非常大时，那么其对应一个非常激进的梯度下降过程，其就是在尝试采取最大的步骤下坡 * 学习率太小，梯度下降会起作用，但需要花费十分多时间 * 学习率太大，会导致发散，找不到局部最优解 * 随着导数的不断变化自动调整步长，不断逼近最小值 *

fixed learning rate



左边为正确的代码写法：要实现并行计算

Correct: Simultaneous update

$$\begin{aligned} \text{tmp_w} &= w - \alpha \frac{\partial}{\partial w} J(w, b) \\ \text{tmp_b} &= b - \alpha \frac{\partial}{\partial b} J(w, b) \\ w &= \text{tmp_w} \\ b &= \text{tmp_b} \end{aligned}$$

Incorrect

$$\begin{aligned} \text{tmp_w} &= w - \alpha \frac{\partial}{\partial w} J(w, b) \\ w &= \text{tmp_w} \\ \text{tmp_b} &= b - \alpha \frac{\partial}{\partial b} J(w, b) \\ b &= \text{tmp_b} \end{aligned}$$

用于线性回归的梯度下降

通过求偏导可得： $w = w - \frac{1}{m} \alpha \sum_{i=1}^m (f_{w,b}(x^{(i)}) - y^{(i)}) x^{(i)}$ $b = b - \frac{1}{m} \alpha \sum_{i=1}^m (f_{w,b}(x^{(i)}) - y^{(i)})$

多元线性回归

多维特征

有多个因素可以影响 y , 因此自变量可以看成一个行向量 模型可以写成: $f_{w,b}(x) = w_1x_1 + w_2x_2 + w_3x_3 + w_4x_4 + b$
 即: $\vec{w} = [w_1, w_2, w_3, w_4]$ $\vec{x} = [x_1, x_2, x_3, x_4]$ 模型可以写成: $f_{\vec{w},b}(\vec{x}) = \vec{w} \cdot \vec{x} + b$

向量化

使用numpy进行运算, 使运算速率加快

Vectorization

$$f_{\vec{w},b}(\vec{x}) = \vec{w} \cdot \vec{x} + b$$

`f = np.dot(w, x) + b`



带有向量化多元线性回归的梯度下降

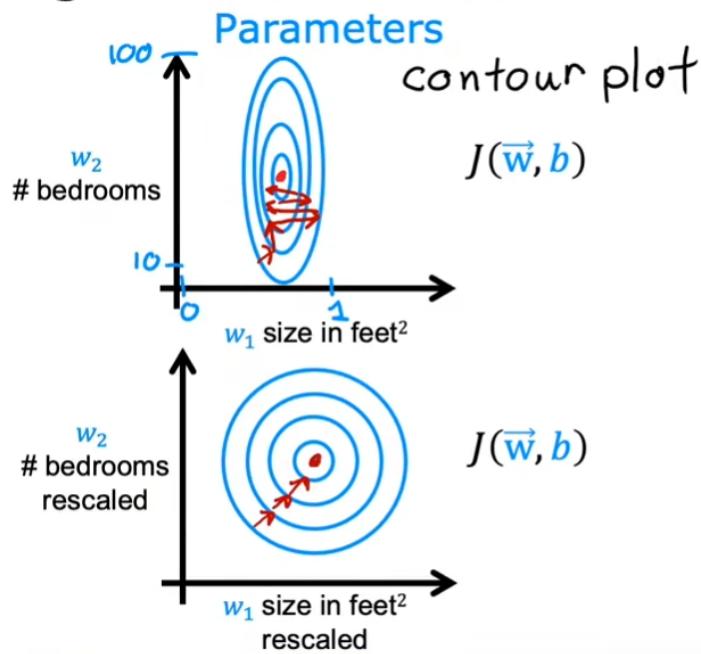
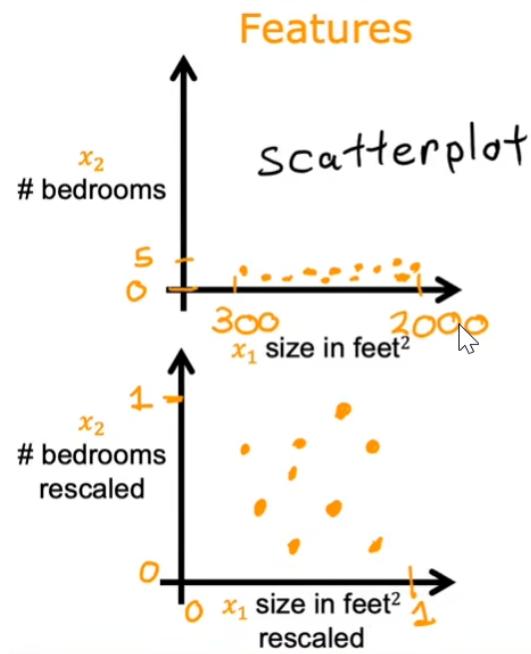
成本函数: $J(\vec{w}, b)$ 梯度下降:

$$w_j = w_j - \alpha \frac{\partial}{\partial w_j} J(w_1, \dots, w_n, b) b = b - \alpha \frac{\partial}{\partial b} J(w_1, \dots, w_n, b) w_j = w_j - \frac{1}{m} \alpha \sum_{i=1}^m (f_{w,b}(x^{(i)}) - y^{(i)}) x_j^{(i)} b = b$$

特征缩放

通过缩放特征使得梯度下降更为方便, 更易找到局部最小值

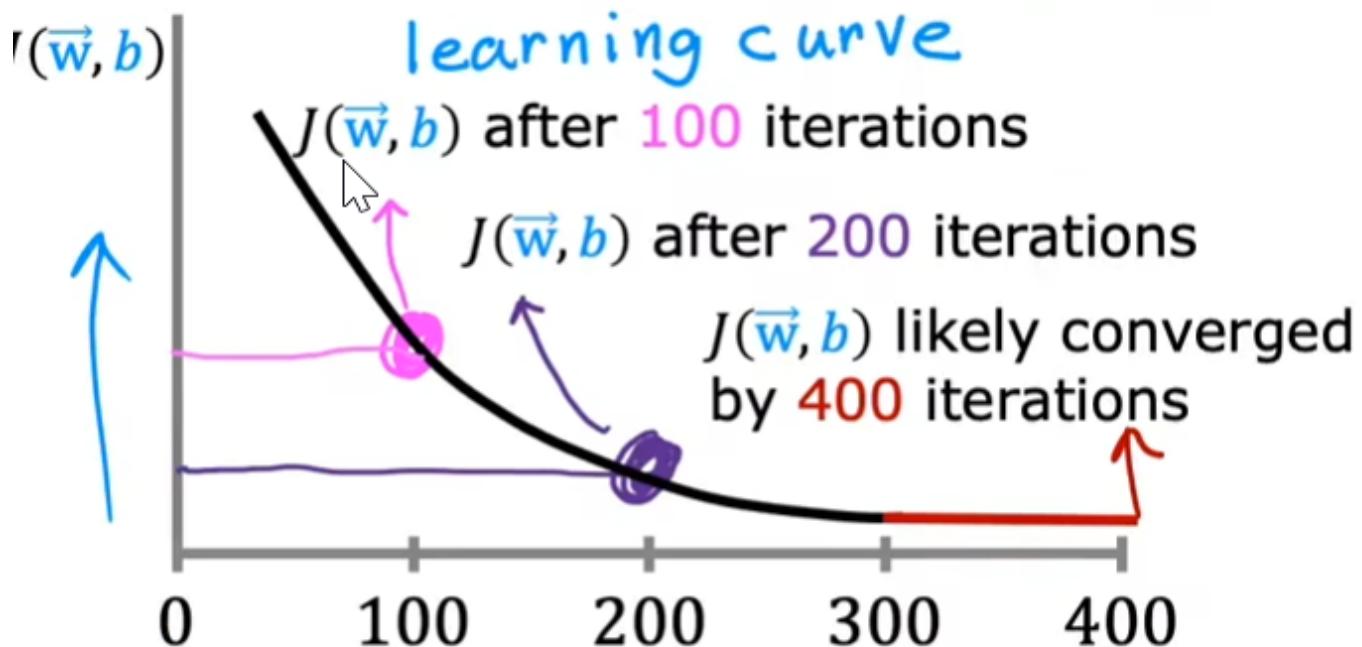
Feature size and gradient descent



方法: 1. 使用数据除以原始数据的范围的最大值, 得出来的数据范围在x轴正半轴 2. 归一化: $x_1 = \frac{x_1 - \bar{x}}{x_{max} - x_{min}}$

学习曲线：利于帮助我们看到梯度下降迭代次数和成本函数之间的关系

objective: $\min_{\vec{w}, b} J(\vec{w}, b)$ $J(\vec{w}, b)$ should decrease after every iteration



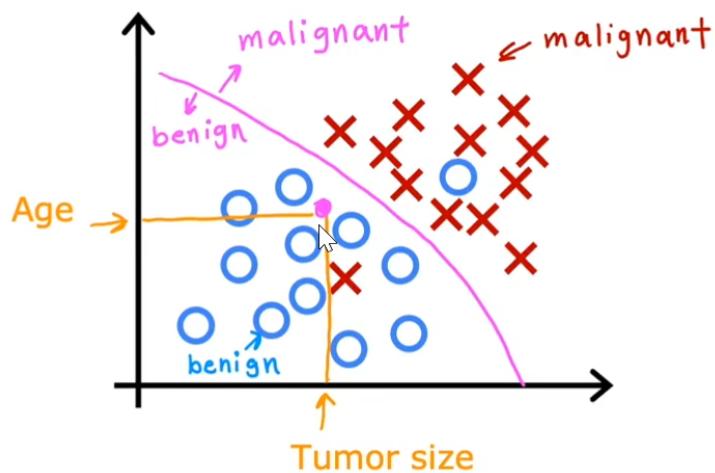
选择好的学习率

- 从小的学习率开始试，尝试几个不同的值后便可选取较为合适的学习率

分类

- 预测的是可能输出类别的有限集合，但不是介于两者之间的所有可能数字

Two or more inputs



- alt text

- 拟合边界线

逻辑回归(单一分类算法)

- sigmoid函数: $g(z) = \frac{1}{1+e^{-z}}$ $0 < g(z) < 1$
- 使用sigmoid函数将实数域映射到(0,1), 并将其作为概率值

逻辑回归函数

- $f_{w,b}(\vec{x}) = \frac{1}{1+e^{-(\vec{w}\vec{x}+b)}}$
- 模型可以有多个特征, 即多元; 也可以有高次幂
- 决策边界:不同类别的分界线

逻辑回归中的成本函数

损失函数是对单个样本的预测误差, 成本函数通常是损失函数求和的平均 线性回归中的成本函数在逻辑回归中并不适用, 因为其有许多极小值, 不利于找到最低成本

Squared error cost

$$J(\vec{w}, b) = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m \frac{1}{2} (f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}) - y^{(i)})^2$$

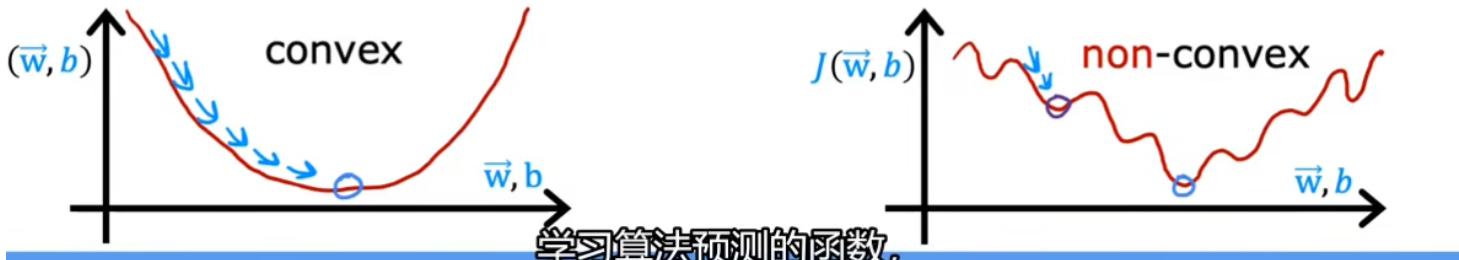
loss $L(f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}), y^{(i)})$

linear regression

$$f_{\vec{w}, b}(\vec{x}) = \vec{w} \cdot \vec{x} + b$$

logistic regression

$$f_{\vec{w}, b}(\vec{x}) = \frac{1}{1 + e^{-(\vec{w} \cdot \vec{x} + b)}}$$



所以要构建一个新的损失函数, 即对数似然损失

$$L(f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}), y^{(i)}) = \begin{cases} -\log(f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)})) & \text{if } y^{(i)} = 1 \\ -\log(1 - f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)})) & \text{if } y^{(i)} = 0 \end{cases}$$

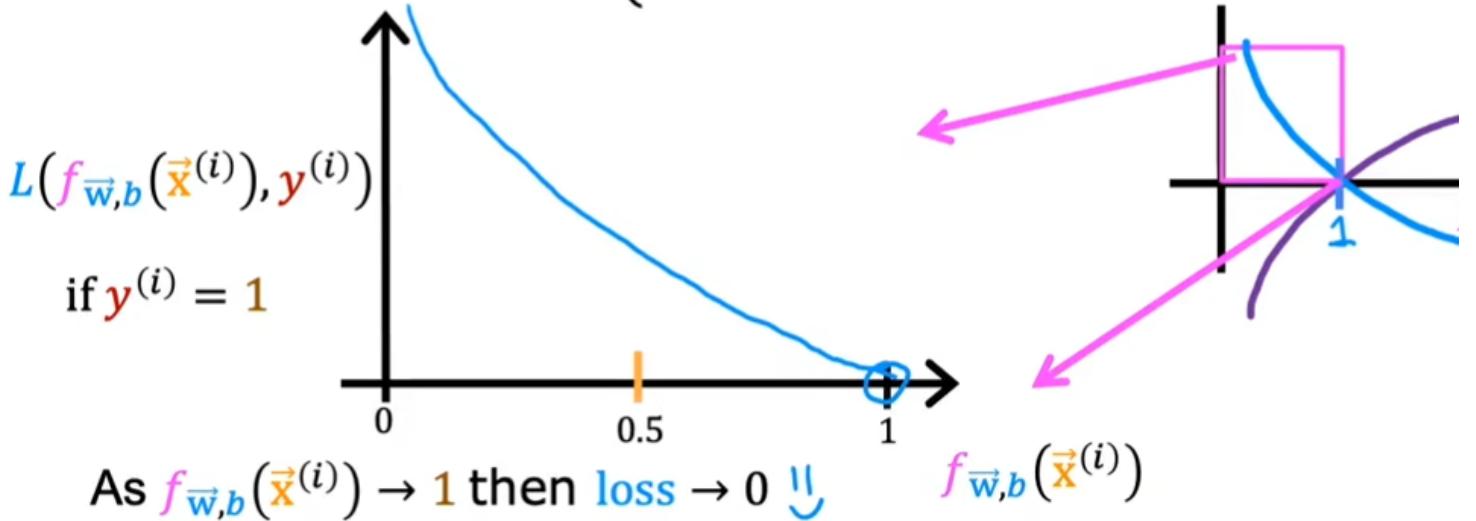
$$L(f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}), y^{(i)}) = -y^{(i)} \log(f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)})) - (1 - y^{(i)}) \log(1 - f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}))$$

if $y^{(i)} = 1$:

下图为真实值为1的损失函数图像, 当f->1, 即预估值趋近1时, y的值很小且斜率趋于0, 表明此时损失很小

Logistic loss function

$$L(f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}), y^{(i)}) = \begin{cases} -\log(f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)})) & \text{if } y^{(i)} = 1 \\ -\log(1 - f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)})) & \text{if } y^{(i)} = 0 \end{cases}$$



目标就是找到最适合的参数使得损失函数(成本函数)的值最小 损失函数：

$L(f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}), y^{(i)}) = -y^{(i)} \log(f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)})) - (1 - y^{(i)}) \log(1 - f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}))$ 成本函数：

$J(\vec{w}, b) = -\frac{1}{m} \sum_{i=1}^m y^{(i)} \log(f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)})) + (1 - y^{(i)}) \log(1 - f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}))$

使用梯度下降来拟合模型

其梯度下降算法与线性回归的基本相同(要进行数学推导)，但f的定义不一样，线性回归的f是 $f=wx+b$ ，而逻辑回归的是sigmoid函数 梯度下降算法：

$$w_j = w_j - \frac{1}{m} \alpha \sum_{i=1}^m (f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}) - y^{(i)}) x_j^{(i)} b = b - \frac{1}{m} \alpha \sum_{i=1}^m (f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}) - y^{(i)})$$

过拟合与欠拟合

- 欠拟合：模型与数据不匹配，具有高偏差(特征较少)
- 过拟合：模型太过完美，能够通过所有训练集，但具有高方差(特征较多，高阶多项)
- 防止过度拟合：
 1. 使用更多的训练数据
 2. 使用更少的特征
 3. 正则化

正则化(线性回归)

通过缩小系数使得特征减少，从而使拟合的曲线更加平滑，不容易产生过拟合 * 正则化参数： λ * 正则化项： $\frac{\lambda}{2m} \sum_{j=1}^n (w_j)^2$ *

成本函数： $J(\vec{w}, b) = \frac{1}{2m} \sum_{i=1}^m (f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}) - y^{(i)})^2 + \frac{\lambda}{2m} \sum_{j=1}^n (w_j)^2$ 正则化参数的大小决定了正则化项所占的权重，我们最后的目的是取什么参数时成本函数能取到最小值。如果正则化参数很大，说明w要很小，这时候回到模型去看会导致欠拟合；

如果正则化参数为0，说明w随意取，这时候会导致过拟合 梯度下降算法：正则化的本质就是让w在每次更新中减小一点，从而让w更小防止过拟合

$$w_j = w_j - \alpha \left(\frac{1}{m} \sum_{i=1}^m (f_{w,b}(x^{(i)}) - y^{(i)}) x_j^{(i)} + \frac{\lambda}{m} w_j \right) b = b - \frac{1}{m} \alpha \sum_{i=1}^m (f_{w,b}(x^{(i)}) - y^{(i)})$$

正则化(逻辑回归)

成本函数： $J(\vec{w}, b) = -\frac{1}{m} \sum_{i=1}^m y^{(i)} \log(f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)})) + (1 - y^{(i)}) \log(1 - f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)})) + \frac{\lambda}{2m} \sum_{j=1}^n w_j^2$

$$w_j = w_j - \frac{1}{m} \alpha \sum_{i=1}^m (f_{w,b}(x^{(i)}) - y^{(i)}) x_j^{(i)} + \frac{\lambda}{m} w_j b = b - \frac{1}{m} \alpha \sum_{i=1}^m (f_{w,b}(x^{(i)}) - y^{(i)})$$

正则化(神经网络)

Neural network regularization

$$\underline{J(\mathbf{W}, \mathbf{B})} = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m L(f(\vec{x}^{(i)}), y^{(i)}) + \frac{\lambda}{2m} \underbrace{\sum_{all\ weights\ \mathbf{W}} (\mathbf{w}^2)}$$

arized MNIST model

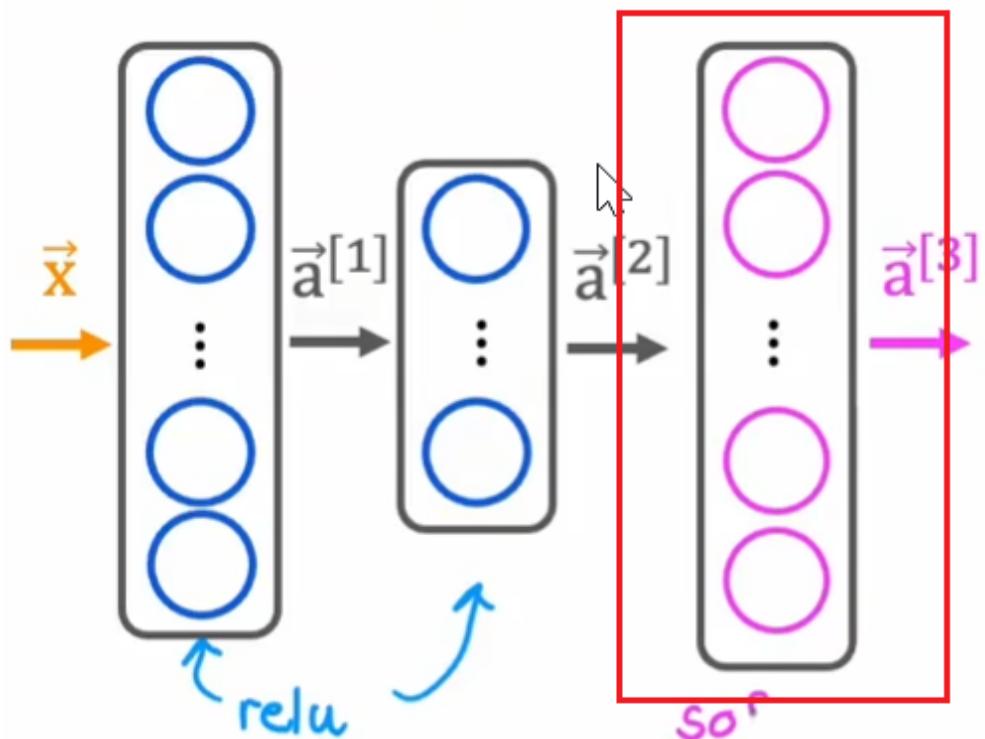
alt text

多类分类

每个样本只能属于一个类别

逻辑回归里面的分类不局限于二元，可以是多元 在输出的时候要换成多个输出单元

Neural Network wi



25 units

15 units

10 units

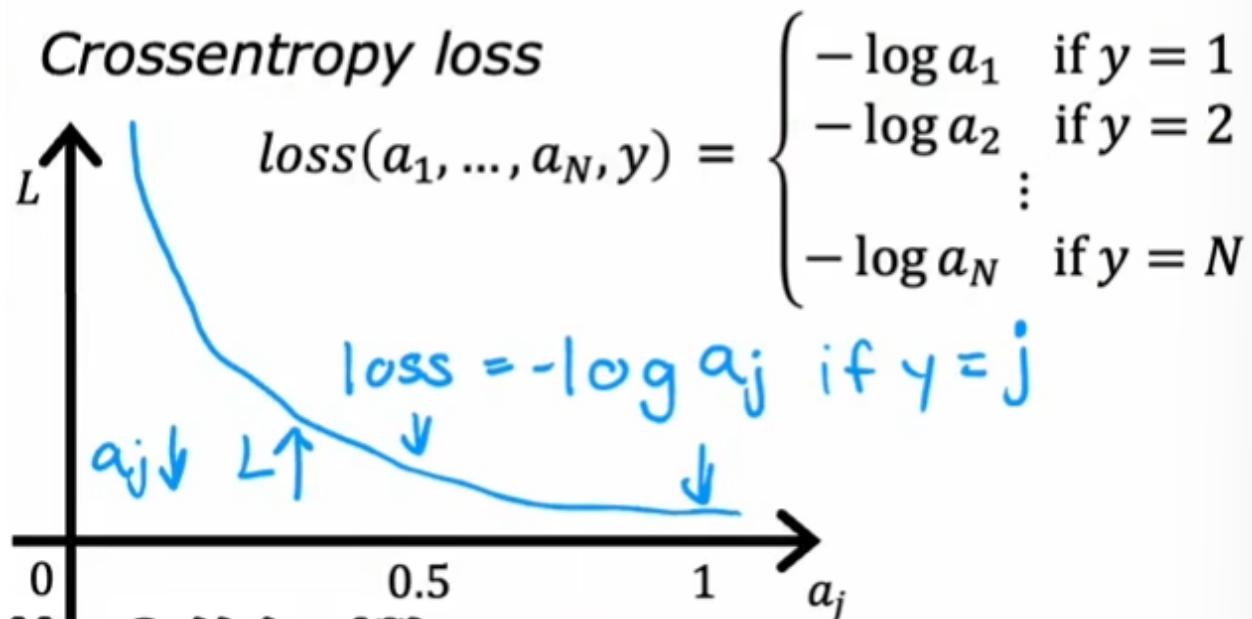
softmax回归

$$z_1 = w_1x + b_1 z_2 = w_2x + b_2 z_3 = w_3x + b_3 a_1 = \frac{e^{z_1}}{e^{z_1} + e^{z_2} + e^{z_3} + e^{z_4}} = P(y = 1 | \vec{x}) a_2 = \frac{e^{z_2}}{e^{z_1} + e^{z_2} + e^{z_3} + e^{z_4}}$$

softmax回归成本函数

Softmax regression

$$a_1 = \frac{e^{z_1}}{e^{z_1} + e^{z_2} + \dots + e^{z_N}} = P(y = 1 | \vec{x})$$
$$\vdots$$
$$a_N = \frac{e^{z_N}}{e^{z_1} + e^{z_2} + \dots + e^{z_N}} = P(y = N | \vec{x})$$



softmax激活函数是多元函数 误差问题：在编写代码的时候，最好不要设置太多的中间变量，不然计算结果会有较大的误差

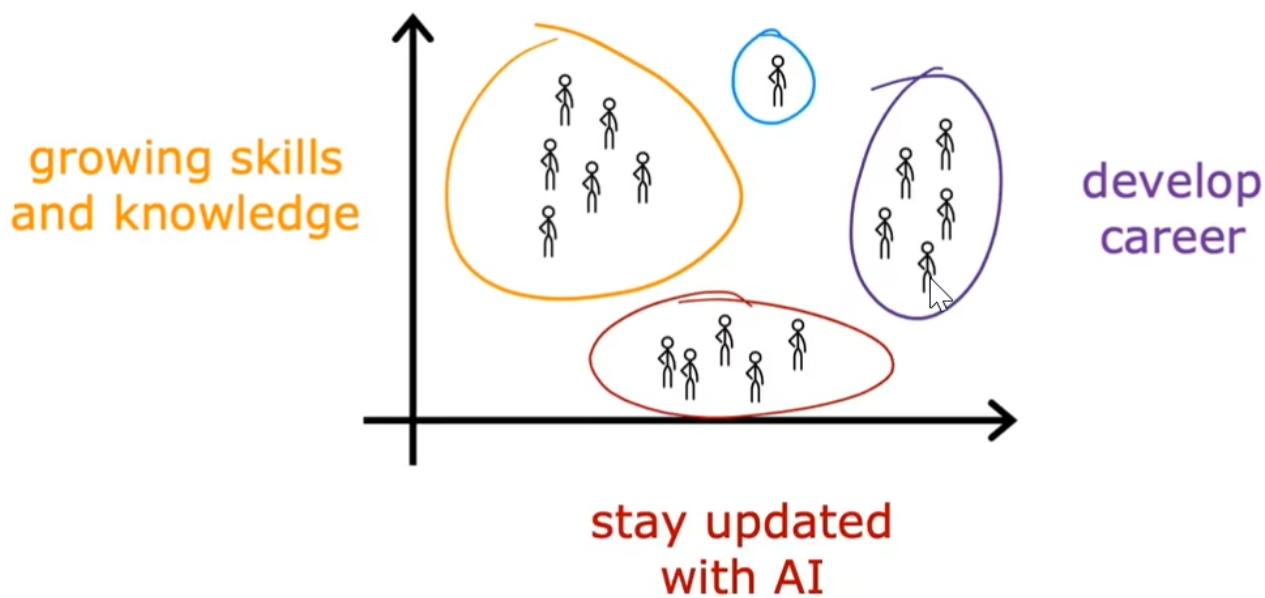
多标签分类

每个样本可以属于多个类别 可以构建多层神经层，一个神经层来判别一个类别

无监督学习 (Unsupervised Learning)

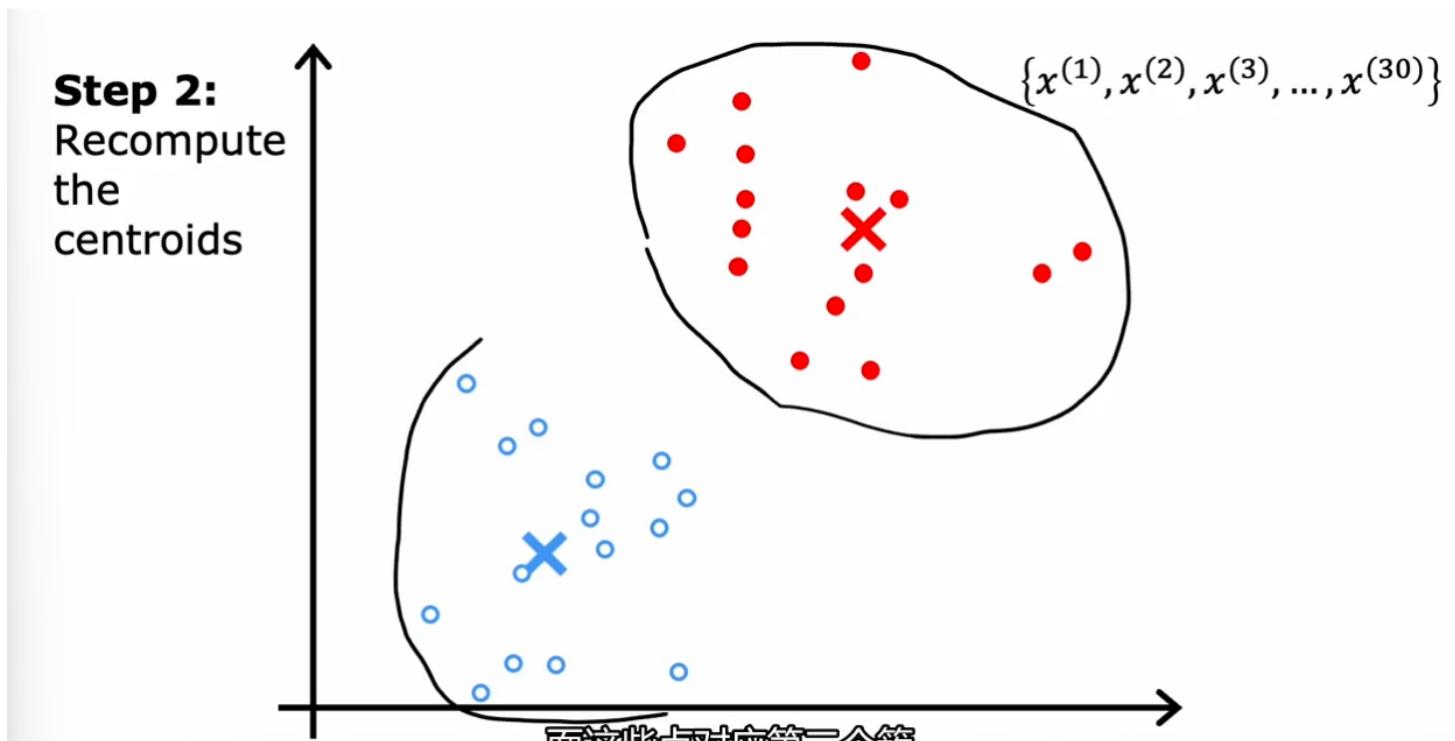
数据仅带有输入x而无输出标签y #### 聚类算法 * 数据集无标签，会把数据分成不同的集群

Clustering: Grouping customers



K-means聚类算法

会重复做的两件事：将点分配给集群质心与移动集群质心 * 随机猜测你可能要求它找到的两个聚类的中心位置 * 遍历每一个点，查看其是否接近红十字还是蓝十字，将点染成对应的颜色 * 查看所有红点的平均位置，并将红十字移到这个平均位置，蓝十字同理



成本函数

- $c^{(i)}$ 可以看作集群中心的索引
- μ_k 指的是集群中心 k 的位置

- $\mu_{c^{(i)}}$ 指的是这个数字所属的簇中心的位置

成本函数(失真函数) $J = (c^{(1)}, \dots, c^{(m)}, \mu_1, \dots, \mu_k) = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m \|x^{(i)} - \mu_{c^{(i)}}\|^2$ * m是样本的总体数量, $x^{(i)}$ 是训练样例 * 降低成本函数: * 将点分配给最近的簇中心, 对 c_i 操作 * 移动簇中心, 移到点的中间位置, 对 μ_i 操作

随机猜测

随机抽取训练样例, 让他们成为簇中心, 但很有可能会使成本函数达到局部最小值, 从而分类不太完美 可以运行多次, 找到多次里面成本函数的最小值

选择簇数量

- 绘制簇数量和成本函数的关系, 选择最小的成本函数

异常检测与降维

- 异常检测: 金融系统中的欺诈检测
- 降维: 将一个大数据集神奇地压缩成一个小的多的数据集, 同时丢失尽可能少的信息

密度估计

根据密度来进行区域划分, 然后根据概率来判断是否是异常 根据高斯分布来进行异常检测, 概率的判断

参数调整

- 根据训练集, 交叉验证集, 测试集
- 可以混入一些异常样例, 在模型对交叉验证集进行异常检测的时候调整参数

多种特征

- 用一个向量来表示多个特征
- 出现的特征是相互独立的, 直接相乘

Density estimation

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

Each example x_i has n features

$$p(\mathbf{x}) = p(x_1; \mu_1, \sigma_1^2) * p(x_2; \mu_2, \sigma_2^2) * p(x_3; \mu_3, \sigma_3^2) *$$

$$\uparrow \quad \uparrow \quad \quad \quad \uparrow \quad \uparrow$$

$$p(x_n; \mu_n, \sigma_n^2)$$

$$= \prod_{j=1}^n p(x_j; \mu_j, \sigma_j^2)$$

$$\mathbf{x} = \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix}$$

$$p(x_1 = \text{high temp}) = 1/10$$

$$p(x_2 = \text{high vibra}) = 1/20$$

$$p(x_1, x_2) = p(x_1) * p(x_2)$$

$$= \frac{1}{10} * \frac{1}{20} = \frac{1}{200}$$

监督学习和异常检测的选择

- 例子少可以用异常检测, 且异常检测检测的是从来没有在训练集中出现的样本

- 使用监督学习会需要使用更多的样本来判断正例是什么样的，从而做出正确的判断，只会判断未来的样本和训练集的是否相似

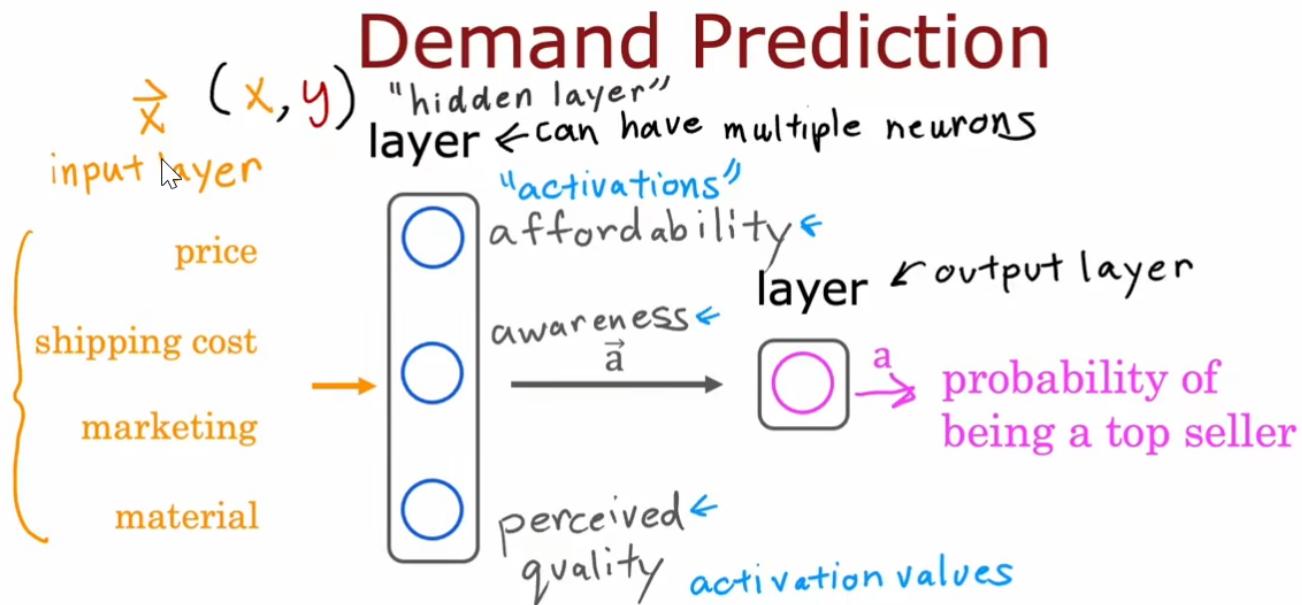
选择合适特征(后续补充)

- 数据选择高斯分布的分布特征

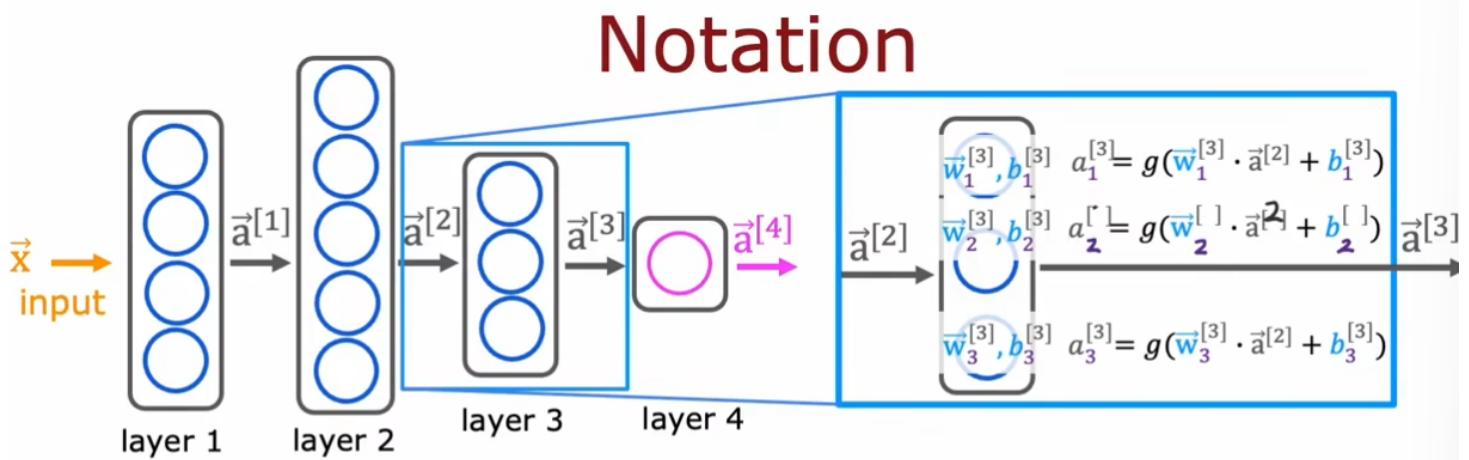
神经网络

神经网络中， w 称为权重(一定有)， b 称为偏置(可有可无)，神经元会根据权重对信号进行缩放，权重是神经元之间的连接强度
与传统的机器学习算法如逻辑回归，线性回归相比，神经网络能带来显著的性能的提高 可以自己学习不同隐藏层的特征检测器
工作原理：
 * 神经元是最小工作单元，多个神经元在一起组成层
 * 一个神经元有一个输出值，前层的输出(激活)是后层的输入
 * 一个神经网络由多个神经层组成，可以接受数字向量的输入和输出
 * 有输入层，输出层和多个隐藏层

- 本质上是用多个神经元分别处理特征，然后将他们的输出值作为一个神经元的输入值，再由其输出概率
- 如下图所示，将处理特征的多个神经元称为层，最左边为输入层，中间为隐藏层，右边为输出层



每个输出和参数右上角的数字表示他隶属于第几层的神经层



激活 指的是一个神经元向他下游的其他神经元发送多少高输出，换句话来说就是神经元输出的计算过程 激活函数：处理输入，得到输出的那部分

泛化

指的是模型不仅在训练集上表现良好，还能再从未见过的新数据上保持良好表现

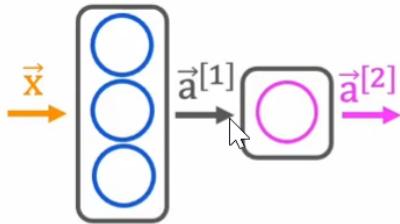
前向传播

在传播神经元的激活

tensorflow

使用sequential方法将神经层串联起来

Building a neural network architecture



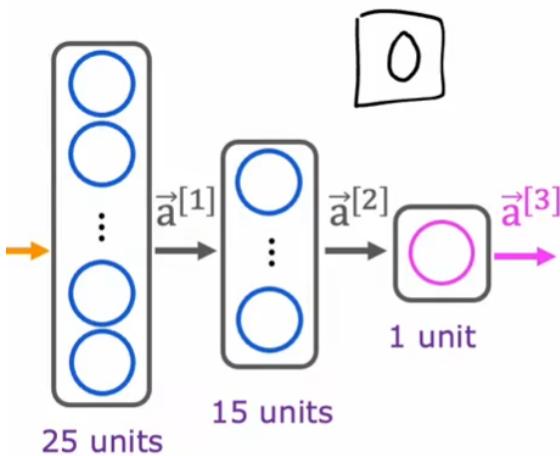
```
→ layer_1 = Dense(units=3, activation="sigmoid")  
→ layer_2 = Dense(units=1, activation="sigmoid")  
→ model = Sequential([layer_1, layer_2])
```

		y
200	17	1
120	5	0
425	20	0
212	18	1

```
x = np.array([[200.0, 17.0],  
              [120.0, 5.0],  
              [425.0, 20.0],  
              [212.0, 18.0]])  
  
targets  
y = np.array([1,0,0,1])  
  
model.compile(...)  
model.fit(x,y)  
  
→ model.predict(x_new)
```

使用tensorflow来编写神经网络代码 1. 指定模型 2. 使用特定损失函数编译模型 3. 训练模型

Train a Neural Network in TensorFlow



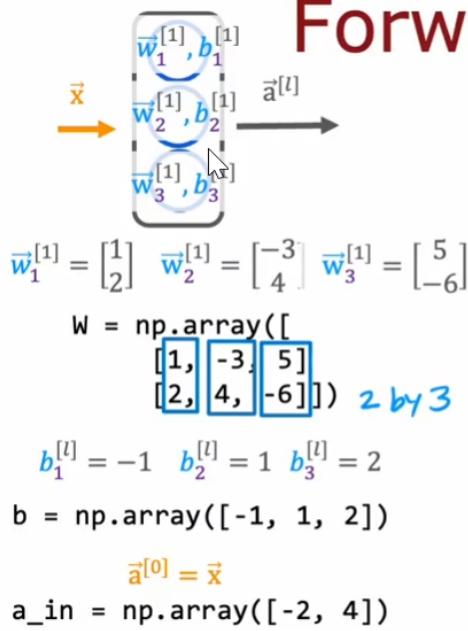
```
import tensorflow as tf  
from tensorflow.keras import Sequential  
from tensorflow.keras.layers import Dense  
  
model = Sequential([  
    Dense(units=25, activation='sigmoid'),  
    Dense(units=15, activation='sigmoid'),  
    Dense(units=1, activation='sigmoid')  
])  
from tensorflow.keras.losses import  
BinaryCrossentropy  
model.compile(loss=BinaryCrossentropy())  
model.fit(X, Y, epochs=100)
```

iven set of (x, y) examples

密集函数及其聚合

看懂代码实现，要有一定numpy基础，要注意是向量还是矩阵

Forward prop in NumPy



```
def dense(a_in, W, b, g):
    units = W.shape[1] [0, 0, 0]
    a_out = np.zeros(units)
    for j in range(units): 0, 1, 2
        w = W[:, j]
        z = np.dot(w, a_in) + b[j]
        a_out[j] = g(z)
    return a_out
```

```
def sequential(x):
    a1 = dense(x, W1, b1)
    a2 = dense(a1, W2, b2)
    a3 = dense(a2, W3, b3)
    a4 = dense(a3, W4, b4)
    f_x = a4
    return f_x
```

capital W refers to a matrix

激活函数

- 线性激活函数: $g(z) = z$
- sigmoid函数, 值域范围是(0,1),适合处理二元分类问题, 因为其有两个平坦面, 其梯度下降速度会更慢
- ReLU函数: $g(z) = \max(0, z)$

优化算法

Adam算法(自动调整学习率)

当梯度下降的方向确实朝着目标方向移动, 增加学习率; 当参数来回震荡, 降低学习率
1. 导入必要的库(torch.optim)
2. 将模型参数和初始学习率导入优化器
3. 记得要把梯度清零

网络层类型

- 密集层: 该层中的每个神经元都从前一层获得所有激活的输入
- 卷积层: 通过卷积核在图片上进行滑动提取特征, 输出通常是三维的

模型性能评估

将数据集分成测试集和训练集(计算训练集和测试集成本时不用加正则化项),通过对测试集和训练集进行成本函数计算, 可以知道模型性能

Train/test procedure for linear regression (with squared error cost)

Fit parameters by minimizing cost function $J(\vec{w}, b)$

$$J(\vec{w}, b) = \min_{\vec{w}, b} \left[\frac{1}{2m_{train}} \sum_{i=1}^{m_{train}} (f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}) - y^{(i)})^2 + \frac{\lambda}{2m_{train}} \sum_{j=1}^n w_j^2 \right]$$

Compute test error:

$$J_{test}(\vec{w}, b) = \frac{1}{2m_{test}} \left[\sum_{i=1}^{m_{test}} (f_{\vec{w}, b}(\vec{x}_{test}^{(i)}) - y_{test}^{(i)})^2 \right]$$

Compute training error:

$$J_{train}(\vec{w}, b) = \frac{1}{2m_{train}} \left[\sum_{i=1}^{m_{train}} (f_{\vec{w}, b}(\vec{x}_{train}^{(i)}) - y_{train}^{(i)})^2 \right]$$

可将数据分为测试集，训练集，交叉验证集，并且基于这三个数据子集的成本函数选择模型 通过交叉验证集去验证模型泛化性能，选择模型，找到最合适的模型

Training/cross validation/test set

Training error: $J_{train}(\vec{w}, b) = \frac{1}{2m_{train}} \left[\sum_{i=1}^{m_{train}} (f_{\vec{w}, b}(\vec{x}^{(i)}) - y^{(i)})^2 \right]$

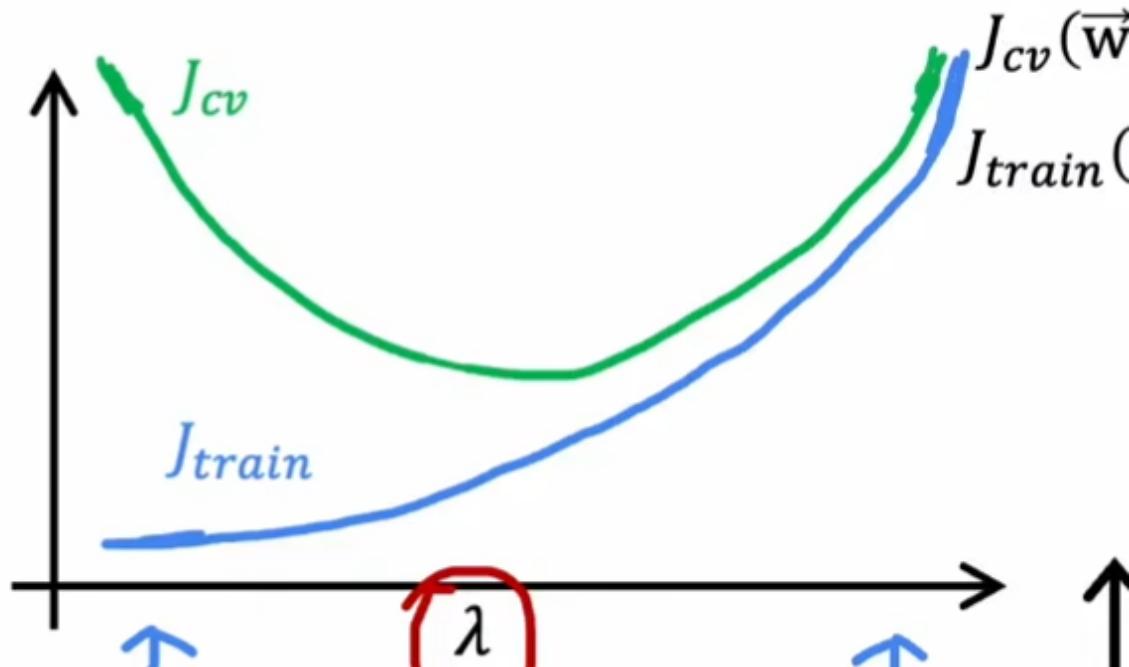
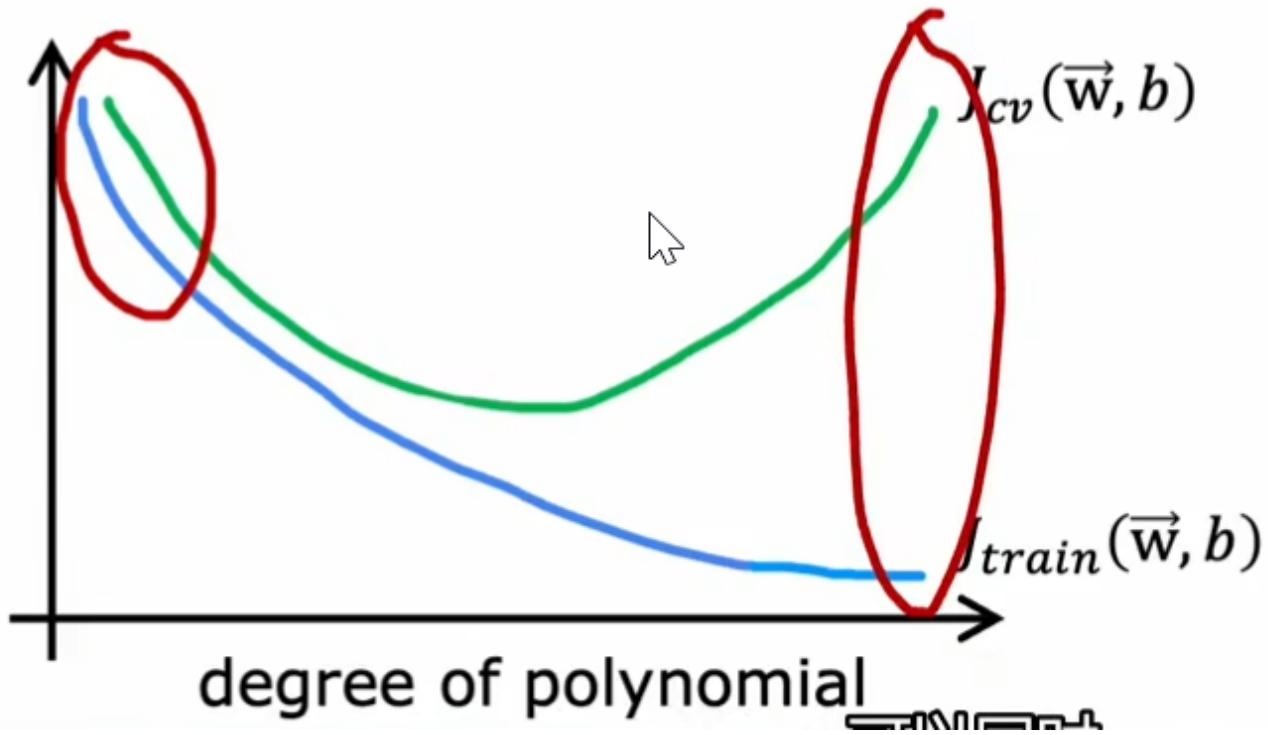
Cross validation error: $J_{cv}(\vec{w}, b) = \frac{1}{2m_{cv}} \left[\sum_{i=1}^{m_{cv}} (f_{\vec{w}, b}(\vec{x}_{cv}^{(i)}) - y_{cv}^{(i)})^2 \right]$ (validation dev err)

Test error: $J_{test}(\vec{w}, b) = \frac{1}{2m_{test}} \left[\sum_{i=1}^{m_{test}} (f_{\vec{w}, b}(\vec{x}_{test}^{(i)}) - y_{test}^{(i)})^2 \right]$

通过偏差和方差评估模型性能

- 高偏差(欠拟合): 训练集的成本函数高
- 高方差(过拟合): 训练集的成本函数低, 但交叉验证集的成本函数高

多项式次数和成本函数之间关系, J_{cv} 为交叉验证集的成本函数



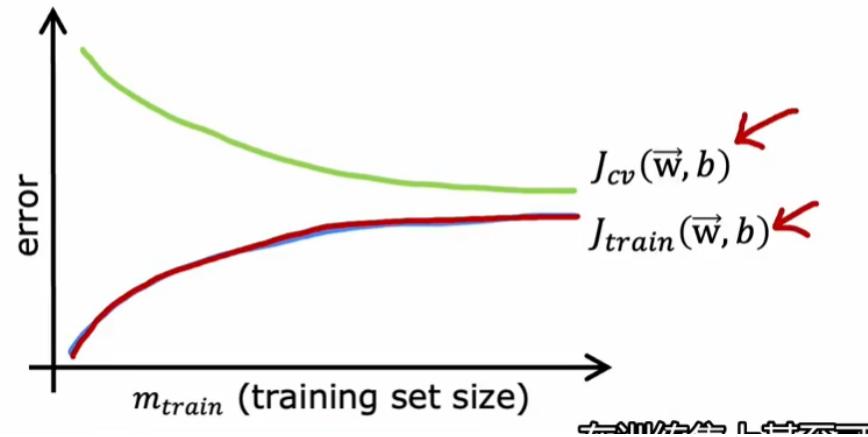
学习曲线

训练集大小和成本函数的关系 增加数据集不会改变成本函数的大小

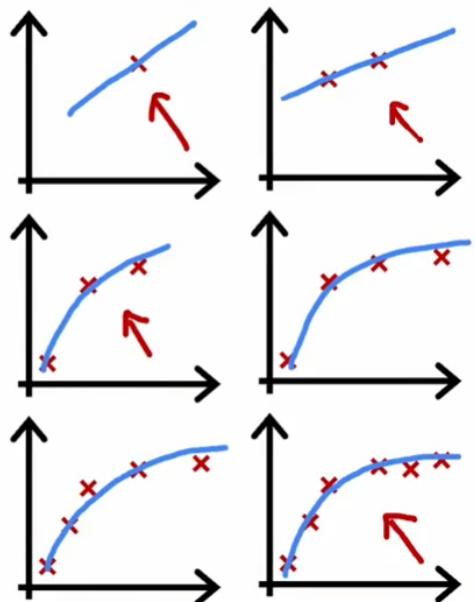
Learning curves

J_{train} = training error

J_{cv} = cross validation error

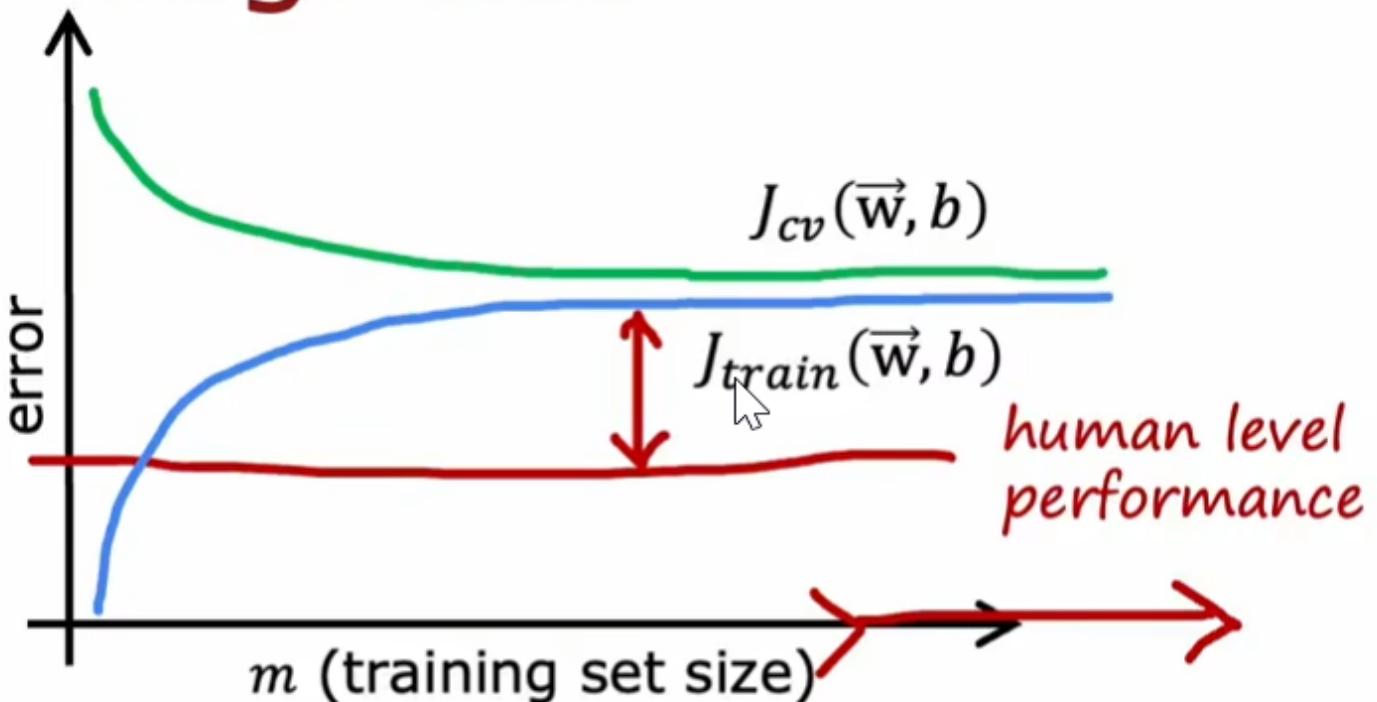


$$f_{\vec{w}, b}(x) = w_1 x + w_2 x^2 + b$$



高偏差图像 因为其模型拟合有问题，所以增加再多的训练集也不会提升模型性能

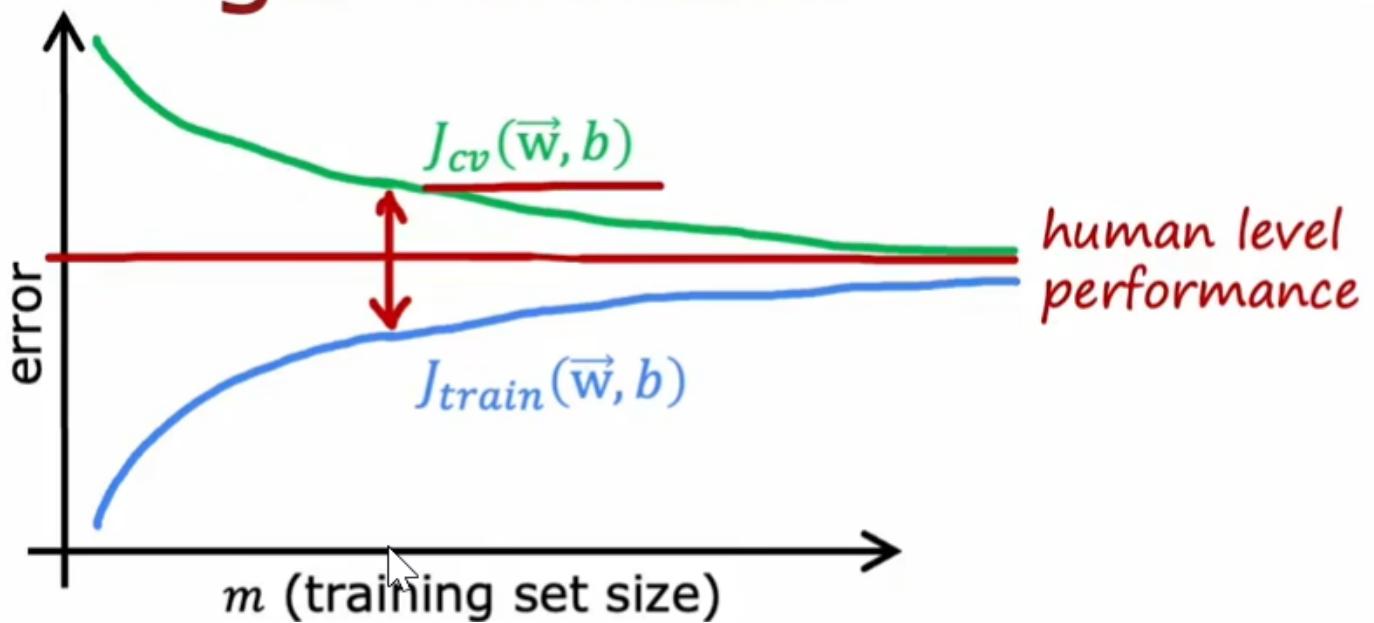
High bias



高方差图像 增加足够多的训练集可以帮助提升模型性能

High variance

f



解决高偏差高方差的方法

- › Get more training examples
- › Try smaller sets of features $x, x^2, \cancel{x}, \cancel{x^2}, \cancel{x^3} \dots$
- › Try getting additional features ↙
- › Try adding polynomial features $(x_1^2, x_2^2, x_1x_2, etc)$
- › Try decreasing λ ↙
- › Try increasing λ ↙

fixes high variance
fixes high variance
fixes high bias
fixes high bias
fixes high bias
fixes high variance

大型神经网络可以降低高偏差

法则：
* 分析偏差方差帮助我们找到解决问题方法，分析数据帮助我们往哪个方向解决问题
* 尝试添加更多有帮助的数据，可以使用数据增强方式来修改原有数据以获取更多数据
* 也可以通过数据合成获取全新数据样例，需要花费较长时间
* 迁移学习：可以复制除输出层之外的参数，然后使用优化算法或者梯度下降更新输出层参数；也可以重新训练所有参数。(先在大型数据集上进行训练，再在较小的数据集上进一步调整参数)
使用别人预训练好的神经网络再对输出层进行微调也是很常见的。

误差指标

横轴为真实类别 纵轴为预测类别

		Actual Class	
		1	0
Predict -ed Class	1	True positive 15	False positive 5
	0	False negative 10	True negative 70
		↓ 25	↓ 75

* 左上角为真阳性，右上角为假阳性 * 左下角为假阴性，右下角为真阴性 * 精度： $\frac{\text{真阳性}}{\text{真阳性} + \text{假阳性}}$ * 召回率： $\frac{\text{真阳性}}{\text{真阳性} + \text{假阴性}}$ **高精度意味着如果患者被诊断患有这种罕见疾病，那么他确实可能患有这种疾病，高召回率意味着如果患者确实有这种疾病，那么他有很大的概率会被诊断出患病**

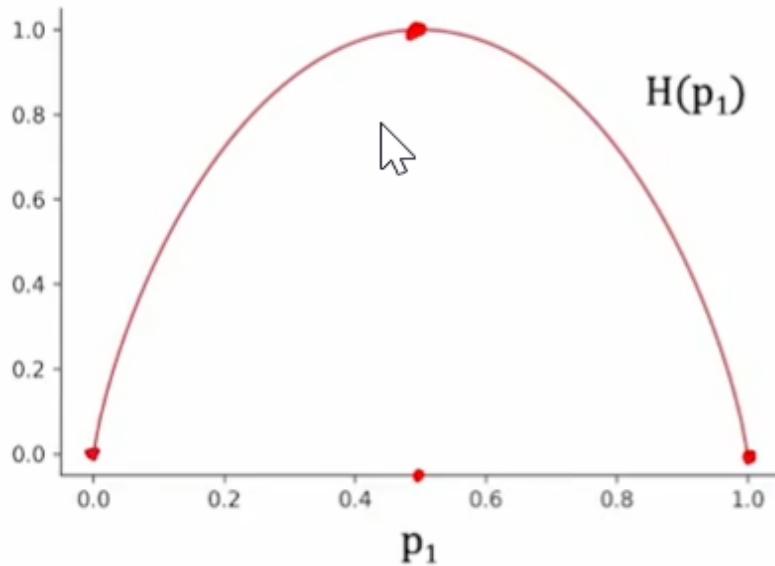
- 二元分类中提高阈值会降低召回率，提高精度
- 降低阈值会降低精度，提高召回率
- 要权衡精确率与召回率，使用F1分数方法(调和平均数)，越高越好 $F1_{SCORE} = \frac{1}{\frac{1}{2}(\frac{1}{P} + \frac{1}{R})} = 2 \frac{PR}{P+R}$

决策树

- 决定在根节点用什么特征
- 选择能获得最大纯度(区分后都是一个类型)的特征

熵：衡量不纯程度的指标 熵和样品比例的关系

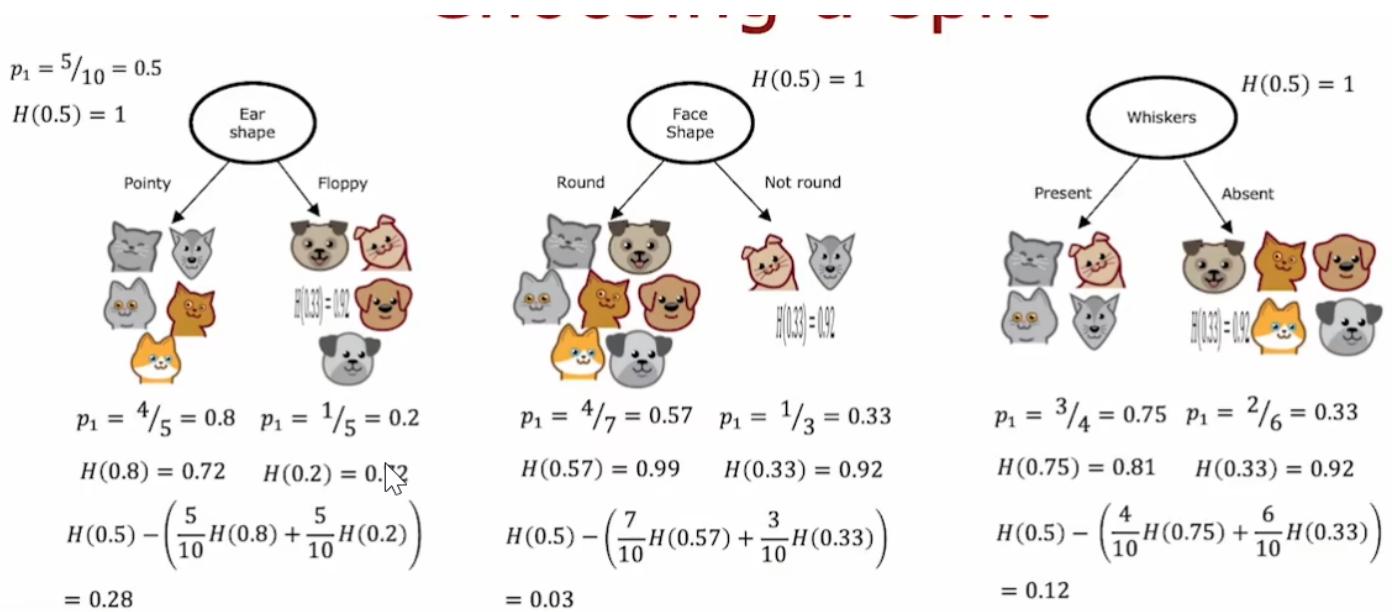
p_1 = fraction of examples that are cats



两个类别的特殊情况，多类别参考周志华的西瓜书

$$p_0 = 1 - p_1 H(p_1) = -p_1 \log_2(p_1) - p_0 \log_2(p_0) = -p_1 \log_2(p_1) - (1 - p_1) \log_2(1 - p_1)$$

熵的减少称为信息增益 使用根节点的熵减去左右分支熵的加权平均(加权的是样本的数量)，可以把左右分支看作是不断减熵优化的过程。最后要选择结果最大的那个



p表示具有正标签的分数，w表示样本数量占总样本的分数 信息增益计算公式：

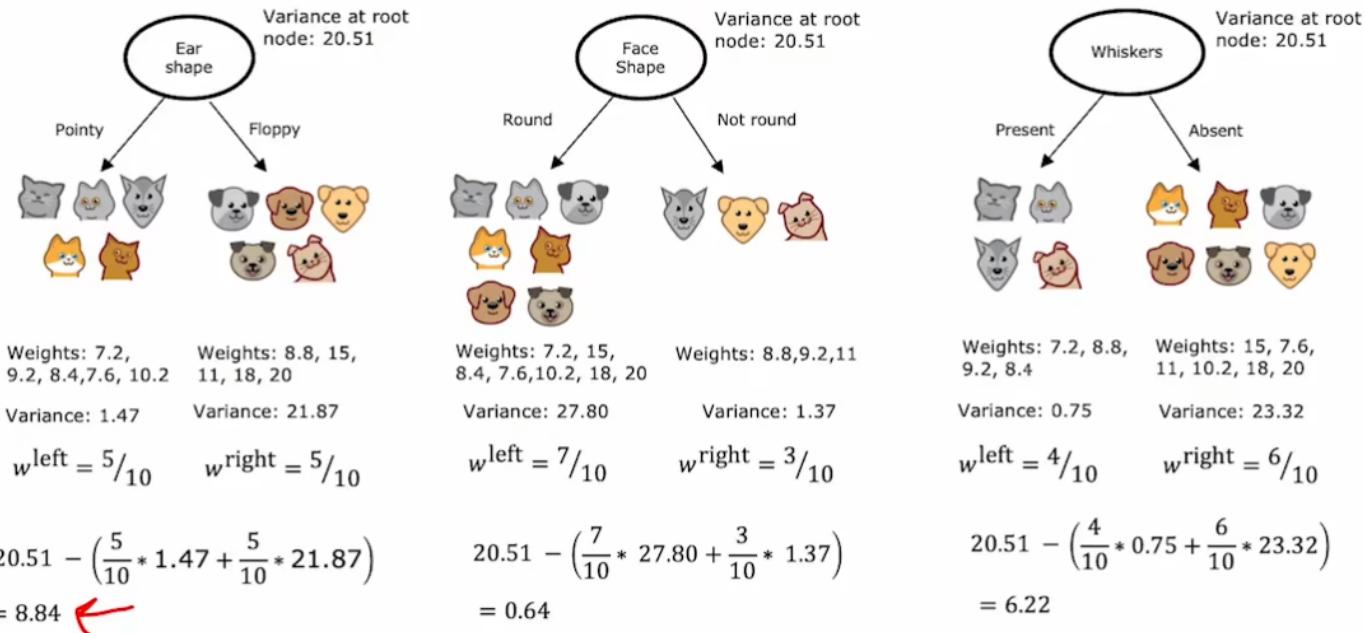
$$H(p_1^{root}) - (w^{left} H(p_1^{left}) + w^{right} H(p_1^{right}))$$

单热编码 如果一个分类特征可以取k个可能的值，那么我们将通过创建k个只能取值0或1的二进制特征来替换他 对于其它特征也可以采用0, 1来替换 * 如果遇到特征是用多个数字表示，那么我们要选择能获得最大信息增益的阈值来进行划分

回归树

我们要尝试减少每个数据子集的值Y的权重方差 使用根节点的方差减去左右分支方差的加权平均(加权的是样本的数量)，要选择的是方差减小最多的那个。

Choosing a split



使用多个决策树(树集成)

使用多个树对同一特征进行递归判断，最后让他们投票，判断最后结果 ##### 替换采样(有放回采样) * 在已有数据里面进行随机抽样，抽取后记录并放回 * 得到一个新的数据集，和原有数据集有些不同但大致相同 * 根据得到的数据集创建新的决策树

随机森林算法

- 训练多个决策树，并将他们合并为一个集合(一般不超过100棵)
- 随机抽取k个特征，在这k个特征里面找到最大的信息增益并选取他作为划分依据

XGBoost

- 对分类错误的样本进行刻意的训练，使得他们能做的更好
- 内置正则化，防止过拟合
- 一个很方便的库，可用于分类与回归

决策树和神经网络优缺点

- 决策树适用于结构性数据，即表格化数据，训练时间短
- 神经网络适用于非结构性数据和结构性数据，如图片，音频，文字等，训练时间长

推荐系统

- 有一定数量的用户和一定数量的项目
- 其目标是向特定用户进行个性化推荐

开发算法

- 拥有电影特征和数据集(用户对电影的评分)
- 会为不同的用户设置不同的权重和偏置

参数 * $r(i, j)$ 为 1 表示用户参与评分，反之则没有 * $y^{(i,j)}$ 表示用户对电影的评分 * $w^{(j)}, b^{(j)}$ 表示为每个用户设定的参数 * $X^{(i)}$ 表示电影 i 的特征向量 * $m^{(j)}$ 表示用户评价的电影数量

预测: $w^{(j)} \cdot X^{(i)} + b^{(j)}$

成本函数(对于所有用户): 包括了正则化系数

To learn parameters $w^{(1)}, b^{(1)}, w^{(2)}, b^{(2)}, \dots, w^{(n_u)}, b^{(n_u)}$ for all users :

$$J\left(\begin{matrix} w^{(1)}, & \dots, & w^{(n_u)} \\ b^{(1)}, & \dots, & b^{(n_u)} \end{matrix}\right) = \frac{1}{2} \sum_{j=1}^{n_u} \sum_{i:r(i,j)=1} \underbrace{(w^{(j)} \cdot x^{(i)} + b^{(j)} - y^{(i,j)})^2}_{f(x)} + \frac{\lambda}{2} \sum_{j=1}^{n_u} \sum_{k=1}^n (w_k^{(j)})^2$$

协同过滤算法

- 根据用户的评分来推荐
- 在开发中我们往往不知道电影特征的参数值，但我们知道用户的评分
- 根据 w 值进行特征值的选取，即使用 $wx+b$ 去拟合用户评分，选取恰当的 x 特征值

电影特征的成本函数

→ To learn $x^{(1)}, x^{(2)}, \dots, x^{(n_m)}$:

$$J(x^{(1)}, x^{(2)}, \dots, x^{(n_m)}) = \frac{1}{2} \sum_{i=1}^{n_m} \sum_{j:r(i,j)=1} (w^{(j)} \cdot x^{(i)} + b^{(j)} - y^{(i,j)})^2 + \frac{\lambda}{2} \sum_{i=1}^{n_m} \sum_{k=1}^n (x_k^{(i)})^2$$

将他们放在一起，成本函数是 w, b, x 的函数

Put them together:

$$\min_{\substack{w^{(1)}, \dots, w^{(n_u)} \\ b^{(1)}, \dots, b^{(n_u)} \\ x^{(1)}, \dots, x^{(n_m)}}} J(w, b, x) = \frac{1}{2} \sum_{(i,j):r(i,j)=1} (w^{(j)} \cdot x^{(i)} + b^{(j)} - y^{(i,j)})^2 + \frac{\lambda}{2} \sum_{j=1}^{n_u} \sum_{k=1}^n (w_k^{(j)})^2 + \frac{\lambda}{2} \sum_{i=1}^{n_m} \sum_{k=1}^n (x_k^{(i)})^2$$

总和和这里的总和是

梯度下降

$$w_i^{(j)} = w_i^{(j)} - \alpha \frac{\partial}{\partial w_i^{(j)}} J(w, b, x)$$

$$b^{(j)} = b^{(j)} - \alpha \frac{\partial}{\partial b^{(j)}} J(w, b, x)$$

$$x_k^{(i)} = x_k^{(i)} - \alpha \frac{\partial}{\partial x_k^{(i)}} J(w, b, x)$$

泛化到二进制标签

- 在用户在网站进行操作的时候分配二进制标签
- 使用逻辑回归中的sigmoid函数
- 损失函数使用二元交叉熵成本函数

$$L(f_{(w,b,x)}(x), y^{(i,j)}) = -y^{(i,j)} \log(f_{(w,b,x)}(x)) - (1 - y^{(i,j)}) \log(1 - f_{(w,b,x)}(x))$$

均值归一化

有利于对未评级的用户做出良好的预测

Movie	Alice (1)	Bob (2)	Carol (3)	Dave (4)	Eve (5)
Love at last	5	5	0	0	?
Romance forever	5	?	?	0	?
Cute puppies of love	?	4	0	?	?
Nonstop car chases	0	0	5	4	?
Swords vs. karate	0	0	5	?	?

$$\min_{\substack{w^{(1)}, \dots, w^{(n_u)} \\ b^{(1)}, \dots, b^{(n_u)} \\ x^{(1)}, \dots, x^{(n_m)}}} \frac{1}{2} \sum_{(i,j): r(i,j)=1} (w^{(j)} \cdot x^{(i)} + b^{(j)} - y^{(i,j)})^2 + \frac{\lambda}{2} \sum_{j=1}^{n_u} \sum_{k=1}^n (w_k^{(j)})^2 + \frac{\lambda}{2} \sum_{i=1}^{n_m} \sum_{k=1}^n (x_k^{(i)})^2$$

Eve (未评级) 的预测值

* 对于未评级的用户，其前面的损失函数为0，因此w和x会为0，这会导致预测值wx+b为0

解决方法：

$$\begin{array}{c}
 \xrightarrow{\quad} \left[\begin{array}{ccccc} 5 & 5 & 0 & 0 & ? \\ 5 & ? & ? & 0 & ? \\ ? & 4 & 0 & ? & ? \\ 0 & 0 & 5 & 4 & ? \\ 0 & 0 & 5 & 0 & ? \end{array} \right] \begin{array}{l} 2.5 \\ 2.5 \\ 2 \\ 2.25 \\ 1.25 \end{array} \\
 \xrightarrow{\quad} \left[\begin{array}{ccccc} 2.5 & & & & ? \\ 2.5 & & & & ? \\ ? & 2 & & -2 & ? \\ -2.25 & -2.25 & 2.75 & 1.75 & ? \\ -1.25 & -1.25 & 3.75 & -1.25 & ? \end{array} \right]
 \end{array}$$

For user j , on movie i predict:

$$w^{(j)} \cdot x^{(i)} + b^{(j)} + \mu_i$$

$y^{(i,j)}$

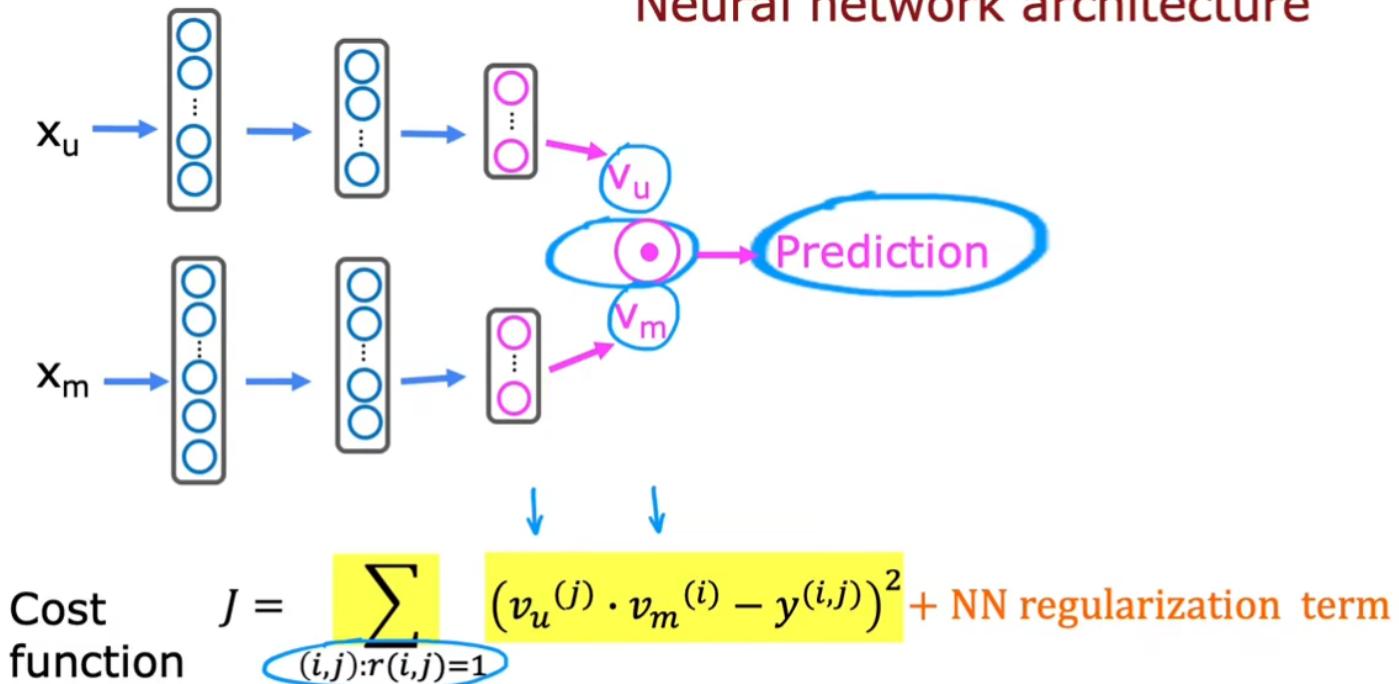
$\dots, \dots, \dots, \dots$

* 将电影的评分放在一个矩阵中，计算每一部电影的评分均值得到一个列向量 * 让评分分别减去对应电影的均值得到新的矩阵 * 此时预测函数为 $wx + b + \mu$, μ 为电影均值，这样未评级的用户就会被预测较为正常的值

基于内容的过滤

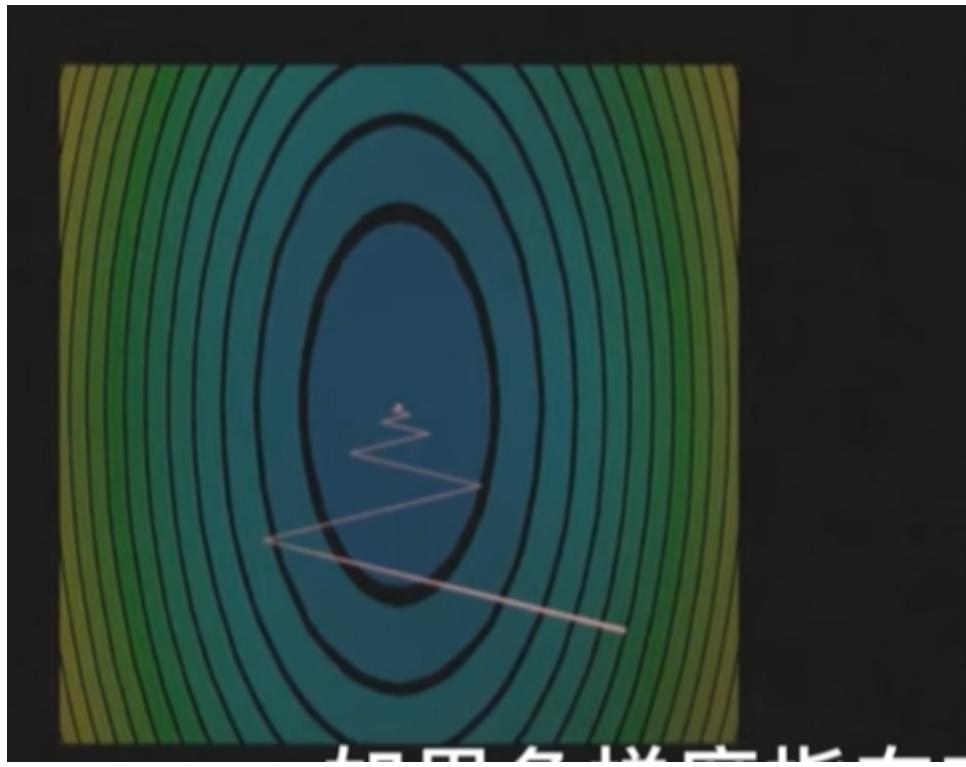
根据用户的特征和物品特征向你推荐物品，需要特征来决定哪些项目可能和用户相匹配 * 根据用户的特征来进行推荐，但用户特征和物品特征大小很可能不一样 * 拟合的模型： $v_u^{(j)} \cdot v_m^{(j)}$, 通过这两个特征来预测用户的评分 * 使用神经网络进行拟合

Neural network architecture



Momentum梯度下降优化算法

- 在常规的SGD中，梯度的下降效率并不是那么高，其会在某一方向上不断震荡，导致下降的速度慢，并且可能会陷入鞍点无法逃出



alt text

- 我们在常规的梯度下降中加入一个超参数 β , 这个值一般取0.9
- 我们在这里使用指数加权平均, 这个方法可以让之前的梯度占取一部分的权重, 并且离该点越近权重越大, 使得当前的下降方向不完全由当前梯度决定, 使得震荡不那么剧烈。并且在陷入鞍点的时候, 之前的梯度的累加可以帮助其不陷入鞍点
- $v_t = \beta v_{t-1} + (1 - \beta) \frac{\partial J}{\partial w} w = w - \alpha v_t$ (α 为学习率)

