**第2章 逻辑回归的训练**

机器学习模型的训练是指根据“训练集”寻找最优模型参数的过程。训练集是指从现实样本分布——总体（population）中采样的包含类别信息的样本集合。

本章首先介绍模型训练的一般概念和模型评价的若干指标，之后探讨二分类问题的损失函数。特别是从衡量两个分布相似程度的K-L散度和最大似然两种角度阐述交叉熵损失函数的含义。

经由损失函数，模型训练问题归约成了以模型参数为自变量，在自变量空间中寻找损失函数最小值的函数优化问题。本章在回顾多元函数微积分的相关知识后介绍梯度下降法及其各种变体。

阅读本章后，读者应当理解了机器学习模型训练的原理和评价模型的方法。本章虽是在逻辑回归框架下进行讲解，但所有概念都可以直接用于神经网络和深度学习。

**2.1 训练集与测试集**

第1章已经介绍，给定权值向量和偏置值，对于样本，逻辑回归模型预测其为A类的概率是：

（2.1）

公式（2.1）中的和就是逻辑回归模型的参数（parameters）。所谓“训练”（training）就是寻找参数和的值，使得模型可以很好地区分A类和B类样本。训练过程需要“训练集”（training set）。训练集由一批带类别信息的样本组成。这些样本是从现实中采样的属于A类或B类的样本。类别信息用一个实数表示，例如用表示样本属于A类；表示样本属于B类。值称为标签（label）。标签的1/0编码只是方法的一种，还可以采用别的编码，例如1/-1。后文会看到不同编码有不同的用途。于是训练集是如公式（2.2）描述的集合。

（2.2）

上标表示样本的编号。训练集*S*中一共包含m个样本。其中每一个是样本特征，是样本标签。

为了评价模型的表现，有必要取另一份带标签的样本集*T*，称为测试集（test set）。在测试集上对训练完成的模型进行评价才能得到客观无偏的评价指标。第3章“正则化”会介绍模型自由度、过拟合、偏置-方差平衡等概念。届时会阐述必须在独立的测试集上评价模型的原因。

**2.2 分类模型的评价**

对于已经训练完成的逻辑回归模型，可以在测试集*T*上评价它的表现。第1章曾提到：对于一个样本，逻辑回归给出的是它属于A类的概率。人有主动权选定一个阈值*t*，当时将判定为属于A类，否则判定属于B类：

（2.3）

对训练集*T*中的所有样本计算逻辑回归模型的输出。一旦选定了阈值*t*，根据公式（2.3）就可以得出模型对每一个样本所判定的类别。和一样，用1/0编码A/B类别。^符号表示是模型预测的标签，与训练集的标签区分。

有了这份判定结果，可以绘制模型的混淆矩阵（confusion matrix）：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | 预测 B 类 | 预测 A 类 |
| 真实 B 类 | TN | FP |
| 真实 A 类 | FN | TP |

表2.1 二分类问题的混淆矩阵

对于二分类问题，混淆矩阵是一个矩阵。从左上到右下每一个元素分别是：

* TN（True Negative）：真实为B类且模型判定为B类的样本个数；
* FP（False Positive）：真实为B类但模型判定为A类的样本个数（被错误地判定为A类）；
* FN（False Negative）：真实为A类但模型判定为B类的样本个数（被错误地判定为B类）；
* TP（True Positive）：真实为A类且模型判定为A类的样本个数。

评价模型表现的几个常用指标（metrics）如下：

（2.4）

正确率*accuracy*是混淆矩阵的对角线元素之和除以全体元素之和。它是模型正确分类的样本个数与全部样本个数之比。有时正确率并非一个良好的评价指标。假如测试集中A类样本和B类样本的数量比为99:1，那么模型将所有样本判定为A类就能够得到99%的正确率，但是该模型显然不是一个好模型。

（2.5）

A类查准率是混淆矩阵右下角元素除以第二列元素之和。它是模型正确判定为A类的样本数量与全部判定为A类的样本数量之比。评价模型判定为A类的准确程度。越高则模型的断言越可靠。

(2.6)

A类查全率是混淆矩阵右下角元素除以第二行元素之和。它是模型判断为A类的样本数量与全部A类样本数量之比。评价模型对A类的召回情况。越高则模型能把更多的A类样本识别出来。又称真阳率（，True Positive Rate）。与之对应还有假阳率（，False Positive Rate）：

(2.7)

是所有B类样本中被模型错判成A类的比例。它越高则模型表现越差。，，都可以针对B类计算。基于混淆矩阵还有其他评价指标，但最常用的是上述几个。

所有这些指标都基于分类结果，而分类结果依赖于概率阈值*t*。*t*是可人为调节的。假如*t*设得较低，可以想象低门槛将导致更多的样本被判定为A类，会较高。但同时也会把更多B类样本错判为A类，从而抬高，拉低。反之，若*t*设得较高，将降低，将升高。所以，选择合适的阈值是在模型两种相反的倾向中进行权衡。权衡的准则依据具体问题的需要。

上述论述可知这对指标随着*t*值变化同进退，一个升高另一个也升高。高是我们愿意看到的，而高是我们希望避免的。我们希望在提高的同时不要大幅度地提高。随着*t*的变化而变化的行为，可由模型的ROC（receiver operating characteristic）曲线来表现。如图2-1所示。

图2-1 ROC 曲线

ROC 曲线以为横轴，以为纵轴，将不同*t*值对应的以散点的形式画在坐标系内。得到的图形是一条拱起的曲线。ROC曲线上拱得越高，说明在较低的水平能够得到较高的。于是ROC曲线下的面积（Area Under Curve，AUC）可被用来衡量模型的质量。AUC越大，ROC曲线越上拱，模型的表现更优。AUC不依赖于阈值*t*的选择，是一个全面衡量模型质量的指标。

我们希望训练得到的模型在测试集上有较优的评价，但是无法用测试集上的指标来指导模型参数的选择。因为评价指标不是模型参数的连续函数。参数在空间中的极微小位移会导致模型输出概率的极微小变化。当这个微小变化不足以使跨越阈值*t*时，模型对样本的分类不发生改变，上述各种评价指标也就不变。而一旦某个微小位移导致了跨越阈值*t*，各个指标将发生跳跃式变化。模型参数和评价指标之间缺乏一个显式的连续的映射，使我们无法利用评价指标来调整模型参数。

存在一些非参数优化方法，例如遗传算法等。它们不依赖模型参数和评价指标之间的显式连续映射。但是这类的效率和资源占用是巨大的。在模型训练中，我们需要采用一种“代理”评价指标。它应该是一个关于模型参数的显式连续函数。这种“代理”评价指标称为损失函数（loss function）。损失函数以某种方式衡量模型的质量。模型的训练问题就变成了在参数空间中寻找损失函数最小值的问题。

**2.3 损失函数**