

# T319 - Introdução ao Aprendizado de Máquina: *Regressão Linear (Parte I)*



***Inatel***

Felipe Augusto Pereira de Figueiredo  
felipe.figueiredo@inatel.br

# Motivação

- **Exemplo 1:** Estimar o preço de casas.
- **Exemplo 2:** Estimar as vendas de sorvete.

500 m<sup>2</sup>



R\$ 1.000.000,00

70 m<sup>2</sup>



R\$ 200.000,00

200 m<sup>2</sup>



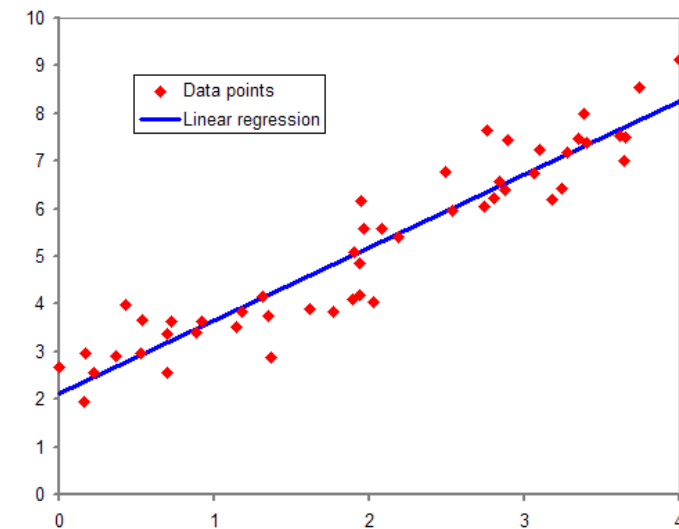
???



- Podemos encontrar uma relação matemática entre a área de uma casa e seu valor?
- Ou da temperatura e a quantidade de sorvetes vendidos?

# Regressão Linear

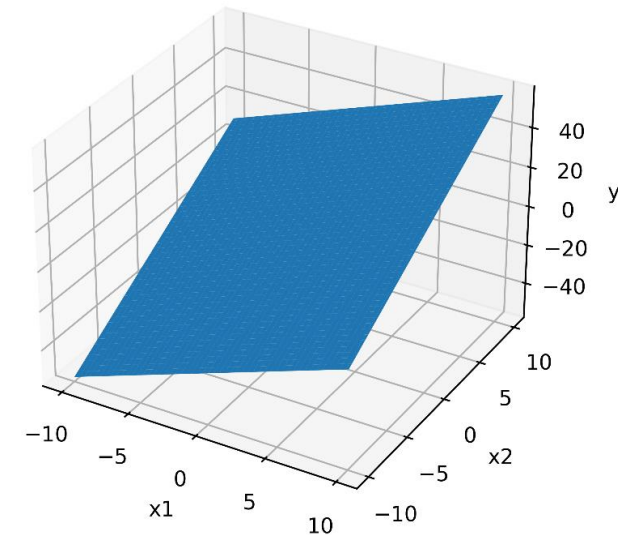
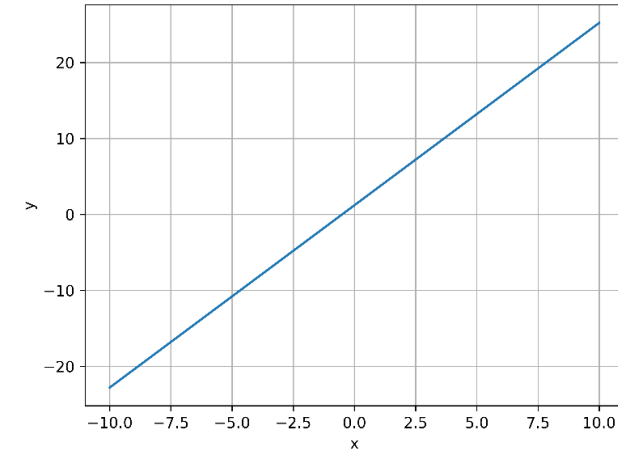
- Um dos mais, se não o mais, conhecido algoritmo de aprendizado de máquina.
- Vai nos dar vários *insights* (i.e., intuições) importantes para o entendimento de outros algoritmos mais complexos, como, classificadores e redes neurais.
- **Objetivo:** encontrar uma função,  $h$ , que mapeie, de forma ótima, os atributos de entrada  $x$  em uma variável de saída  $y$ :  $y = h(x)$ , de tal forma que  $h(x)$  seja uma boa aproximação da *função verdadeira*, mas desconhecida, chamada de *função objetivo*,  $f(x)$ .
- Regressão também é conhecida como *aproximação de funções*.
- Como faríamos para encontrar uma função,  $h(x)$ , que *aproxime*  $f(x)$  de forma ótima?



Temos  $x$  (atributos) e  $y$  (rótulos) e queremos encontrar  $\hat{y} = h(x)$ .

# Regressão Linear

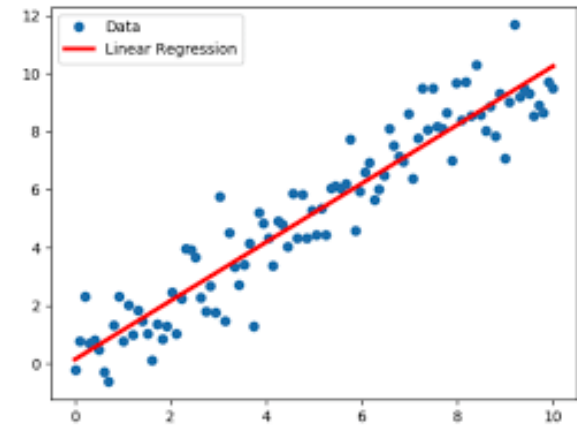
- **Qual forma deve ter a função  $h(\mathbf{x})$ ?** Os modelos mais simples são:
  - Com apenas um atributo,  $x_1$ ,  $h(\mathbf{x})$  é uma reta,  $h(\mathbf{x}) = a_0 + a_1 x_1$ .
  - Com dois atributos,  $x_1$  e  $x_2$ ,  $h(\mathbf{x})$  é uma superfície 2D (ou seja, um plano),  $h(\mathbf{x}) = a_0 + a_1 x_1 + a_2 x_2$ .
  - E assim por diante.
- **Modelo geral:** Equação de um Hiperplano
$$h(\mathbf{x}) = a_0 + a_1 x_1 + \dots + a_K x_K = a_0 + \sum_{i=1}^K a_i x_i.$$
- Existem outros modelos, os quais veremos mais adiante.
- Na literatura, a função  $h(\mathbf{x})$ , é chamada de **função hipótese**, pois é uma das possíveis soluções encontradas no **espaço de hipóteses**,  $H$ .
- **Espaço de hipóteses:** é conjunto de todas as possíveis **funções hipótese**.
  - Hiperplano formado por todos possíveis valores dos parâmetros,  $a_k, \forall k$ .



# Regressão Linear

- **Objetivo:** Encontrar os **parâmetros**, também chamados de **pesos**,  $a_0, a_1, \dots, a_k$  de tal forma que  $h(\mathbf{x})$  seja uma ótima aproximação de  $f(\mathbf{x})$ .
- **Aprendizado supervisionado:** atributos/exemplos (i.e.,  $\mathbf{x}$ ) mais rótulos/objetivos (i.e.,  $y$ ).
- A **regressão** é chamada de **linear** porque a variável de saída,  $y$ , é modelada como uma **combinação linear** dos atributos,  $\mathbf{x}$ .
  - **OBS.: Linear** significa “*linear com relação aos pesos*” e não com relação aos atributos, i.e.,  $\mathbf{x}$ . Desta forma, os seguintes modelos também são lineares com relação aos pesos:
    - $y = a_0 + a_1 \log x_1 + a_2 \cos x_2$
    - $y = a_0 + a_1 e^{x_1}$
    - $y = a_0 + a_1 x_1^2$

# Definição do Problema



O problema de **regressão** pode ser enunciado da seguinte forma:

- **Dados disponíveis:**

- Conjunto de  $N$  observações (conjunto de pares de treinamento) :  $\{x(i), y(i)\}$ ,  $i = 0, \dots, N - 1$ , onde
  - $x(i) \in \mathbb{R}^K$  :  $i$ -ésimo vetor de entrada com dimensão  $K$ , ou sejam  $K$  atributos (ou features).
  - $y(i) \in \mathbb{R}$  :  $i$ -ésimo valor esperado de saída referente ao vetor de entrada  $x(i)$ .

- **Modelo:**

$$h(x(i)) = a_0 + a_1 x_1(i) + \dots + a_K x_K(i) = \mathbf{a}^T \Phi(i),$$

onde  $\mathbf{a} = [a_0, \dots, a_K]^T$  e  $\Phi(i) = [1, x_1(i), \dots, x_K(i)]^T$ .

- $\mathbf{a}$  é o vetor  $(K + 1 \times 1)$  contendo os parâmetros/pesos que definem a **função hipótese**, ou seja, o mapeamento  $h: x(i) \rightarrow \hat{y}(i)$  e  $\Phi(i)$  é um vetor  $(K + 1 \times 1)$  contendo os  $i$ -ésimos valores dos atributos.
- $a_0$  é o **coeficiente linear**, ou seja, é o valor de  $h(x)$  para o ponto em que o hiperplano intercepta o eixo  $y$ ,  $a_0$  é conhecido também como **intercept**.
- Como  $a_0$  não tem um atributo relacionado, para facilitar o modelamento matemático, supomos um atributo constante sempre unitário,  $x_0 = 1$ .
- **Objetivo do modelo:** encontrar o vetor de pesos  $\mathbf{a}$  que minimize o **erro**, dado por uma **função de erro**,  $J_e(\mathbf{a})$ , entre a aproximação  $\hat{y}(i)$  e o valor desejado  $y(i)$  para todo  $i$ .

$$\min_{\mathbf{a}} J_e(\mathbf{a})$$

Ou seja, **o treinamento do modelo envolve a minimização de uma função de erro.**

# Função de Erro

- **Função de erro:** existem várias possibilidades para se definir a **função de erro** a ser minimizada, porém, geralmente, utiliza-se a medida do **erro quadrático médio**

$$J_e(\mathbf{a}) = \frac{1}{N} \sum_{i=0}^{N-1} (y(i) - \hat{y}(i))^2 = \frac{1}{N} \sum_{i=0}^{N-1} (y(i) - h(\mathbf{x}(i), \mathbf{a}))^2,$$

que nada mais é do que a média do somatório dos erros ao quadrado.

- Nós veremos mais adiante a razão pela qual o **erro quadrático médio** é utilizado.
- A **função de erro** pode ser reescrita em forma matricial como

$$J_e(\mathbf{a}) = \frac{1}{N} \|\mathbf{y} - \Phi \mathbf{a}\|^2,$$

onde  $\mathbf{y} = [y(0), \dots, y(N-1)]^T$  é um vetor  $(N \times 1)$ ,  $\Phi = [\Phi(0), \dots, \Phi(N-1)]^T$  é uma matriz  $(N \times K+1)$  e  $N$  é o número de amostras, exemplos ou observações.

- Então, para encontrar o vetor de parâmetros  $\mathbf{a}$  devemos minimizar

$$\min_{\mathbf{a} \in \mathbb{R}} \|\mathbf{y} - \Phi \mathbf{a}\|^2.$$

# Minimizando a Função de Erro

## Como encontramos o mínimo da função de erro em relação aos pesos?

- Da disciplina de cálculo, sabemos que derivando  $\|\mathbf{y} - \Phi \mathbf{a}\|^2$  com relação a  $\mathbf{a}$  e igualando a 0 nós encontramos o ponto onde a inclinação da função de erro é nula:

$$\frac{\partial \|\mathbf{y} - \Phi \mathbf{a}\|^2}{\partial \mathbf{a}} = 2\mathbf{a}^T \Phi^T \Phi - 2\mathbf{y}^T \Phi = 0.$$

- Portanto, voltando à equação da derivada primeira igual a 0, temos

$$\mathbf{a}^T \Phi^T \Phi = \mathbf{y}^T \Phi.$$

- Após aplicarmos o transposto a ambos os lados e isolando  $\mathbf{a}$  temos

$$\mathbf{a} = (\Phi^T \Phi)^{-1} \Phi^T \mathbf{y}.$$

- Essa equação é conhecida como a **equação normal** e nos dá a **solução ótima** em relação a minimização o erro quadrático médio para esse sistema de equações.



# Minimizando a Função de Erro

## Observações:

1. O método encontra uma ***solução única*** se e somente se a matriz quadrada  $\Phi^T \Phi$  for ***invertível***.
2. O método só funciona para sistemas ***sobredeterminados***, ou seja, mais equações (i.e., pares de exemplos  $x$  e  $y$ ) do que incógnitas (i.e., pesos),  $N \geq K + 1$ .
3. Para sistemas ***subdeterminados***, ou seja, que têm menos equações do que incógnitas, a matriz  $\Phi^T \Phi$  é ***singular***. Neste caso, não existe solução ou ela não é única.

# Regressão Linear em Python

```
# Import all the necessary libraries.
```

```
import numpy as np
```

```
# Generate input/output (features/labels) values.
```

```
N = 100; # Number of observations.
```

```
x = 2 * np.random.rand(N, 1)
```

```
y = 4 + 3 * x
```

```
y_noisy = y + np.random.randn(N, 1)
```

```
# Solve by applying the least-Squares method.
```

```
# We use the inv() function from NumPy's Linear Algebra module (np.linalg) to  
compute the inverse of a matrix.
```

```
# We use dot() method for matrix multiplication.
```

```
X_b = np.c_[np.ones((N, 1)), x] # add x0 = 1 to each instance
```

```
a_optimum = np.linalg.inv(X_b.T.dot(X_b)).dot(X_b.T).dot(y_noisy)
```

```
# Print best solution.
```

```
print('a0: %1.4f' % (a_optimum[0][0]))
```

```
print('a1: %1.4f' % (a_optimum[1][0]))
```

```
a0: 4.0763
```

```
a1: 2.9413
```

```
# The equivalent solution using the Scikit-Learn library is given below
```

```
# Import the linear regression module from the library.
```

```
from sklearn.linear_model import LinearRegression
```

```
lin_reg = LinearRegression() # instantiate it.
```

```
lin_reg.fit(x, y_noisy)
```

```
print('a0: %1.4f' % (lin_reg.intercept_[0])) # Value that crosses the y-axis when all features  
are equal to 0.
```

```
print('a1: %1.4f' % (lin_reg.coef_[0][0])) # parameters associated with the features.
```

```
a0: 4.0763
```

```
a1: 2.9413
```



<https://scikit-learn.org>

## [Exemplo: normal equation example1.ipynb](#)

- Percebam que com apenas 100 exemplos, os valores obtidos são bem próximos dos exatos, porém, o ruído torna impossível recuperar os parâmetros exatos da função original.
- Se aumentarmos o número de exemplos conseguimos melhorar a estimação, porém, o ruído limitará essa melhoria.
- O argumento  $x$  passado para o método fit da classe **LinearRegression** é uma matriz com  $N \times K$ . Porém, lembrem-se que se existe um peso  $a_0$ , e portanto  $x$  deveria ter dimensão  $N \times K+1$ , entretanto, por padrão, a classe **LinearRegression** já faz isso pra vocês automaticamente. Caso sua função hipótese não considere o peso  $a_0$ , então, durante a instanciação da classe vocês devem configurar o parâmetro **fit\_intercept=False**.

# Superfície de Erro

- E se plotarmos a função de erro,  $J_e(\mathbf{a})$ ? Que forma vocês acham que ela teria?
- $J_e(\mathbf{a})$  faz o mapeamento entre cada possível valor dos parâmetros do modelo e o erro correspondente:
  - $J_e(\mathbf{a}): \mathbb{R}^{K+1} \rightarrow \mathbb{R}$ . Esse mapeamento define a **superfície de erro**.

- $J_e(\mathbf{a})$  assume uma forma **quadrática** com respeito ao **vetor de pesos**,  $\mathbf{a}$ .

$$J_e(\mathbf{a}) = \|\mathbf{y} - \Phi\mathbf{a}\|^2 = \mathbf{y}^T \mathbf{y} - \mathbf{y}^T \Phi\mathbf{a} - \mathbf{a}^T \Phi^T \mathbf{y} + \mathbf{a}^T \Phi^T \Phi \mathbf{a}.$$

- Consequentemente, a superfície é **convexa** (ou seja, tem forma de tigela), e portanto possui um único **mínimo global**, que pode ser encontrado, por exemplo, pela **equação normal**.

- Isso é provado mostrando-se que  $\frac{\partial^2 \|J_e(\mathbf{a})\|^2}{\partial^2 \mathbf{a}} = 2\Phi^T \Phi$  é uma **matriz positiva semi-definida**, e portanto,  $J_e(\mathbf{a})$  sempre será **convexa** com relação ao vetor de pesos,  $\mathbf{a}$ .

# Superfície de Erro: Exemplo #1

- A figura ao lado mostra a **superfície de erro** para a seguinte **função observável**:

$$y_{\text{noisy}}(n) = y(n) + w(n),$$

onde  $w(n) \sim N(0,1)$  e  $y(n)$  é a **função objetivo**.

- Neste exemplo, a **função objetivo** (ou **modelo gerador**) é dada por:

$$y(n) = x_1(n),$$

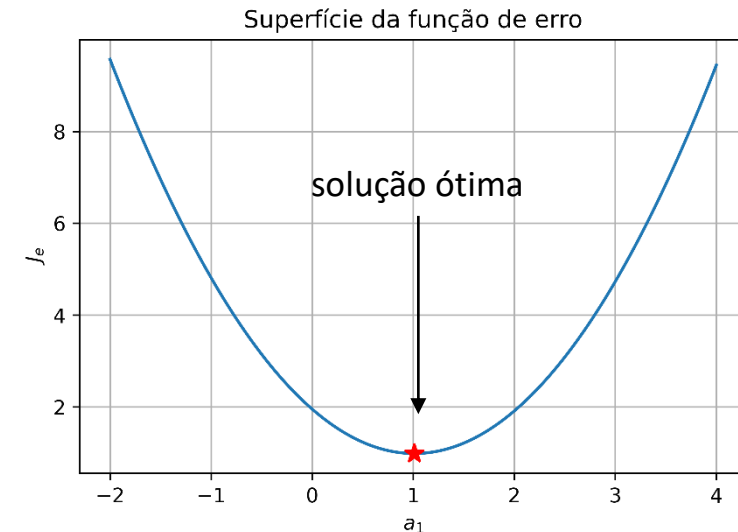
onde  $x_1(n) \sim N(0,1)$ .

- A **função hipótese**,  $h(x)$ , é dada por
$$h(x) = \hat{y} = a_1 x_1(n).$$

- O erro **erro quadrático médio** é calculado como

$$J_e(a_1) = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} (y(n) - \hat{y}(n))^2 = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} (y(n) - a_1 x_1(n))^2.$$

[Exemplo: error\\_surface\\_example1.ipynb](#)



O erro é calculado variando-se  $a_1$  na equação do EQM.

# Superfície de Erro: Exemplo #2

[Exemplo: error surface example2.ipynb](#)

Superfície da função de erro

- A figura ao lado mostra a **superfície de erro** para a seguinte **função observável**:

$$y_{\text{noisy}}(n) = y(n) + w(n),$$

onde  $w(n) \sim N(0,1)$  e  $y(n)$  é a **função objetivo**.

- Neste exemplo, a **função objetivo** (ou **modelo gerador**) é dada por:

$$y(n) = x_1(n) + x_2(n),$$

onde  $x_1(n)$  e  $x_2(n) \sim N(0,1)$

- A **função hipótese**,  $h(x)$ , é dada por

$$h(x) = \hat{y} = a_1 x_1(n) + a_2 x_2(n).$$

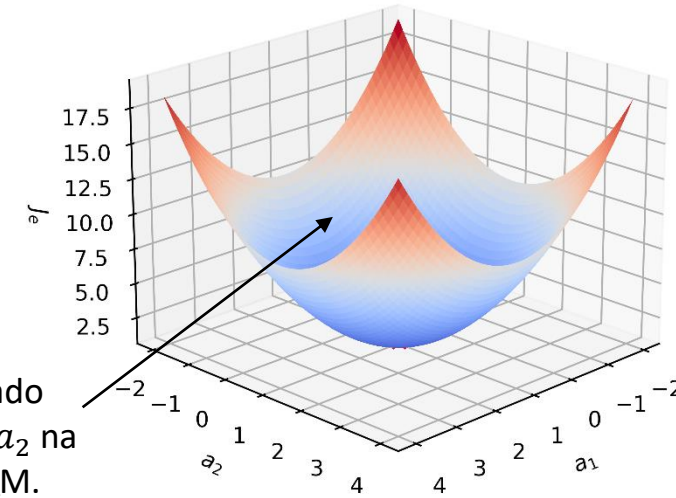
- O erro **erro quadrático médio** é calculado como

$$\begin{aligned} J_e(a_1, a_2) &= \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} (y_{\text{noisy}}(n) - \hat{y}(n))^2 \\ &= \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} (y_{\text{noisy}}(n) - (a_1 x_1(n) + a_2 x_2(n)))^2 \end{aligned}$$

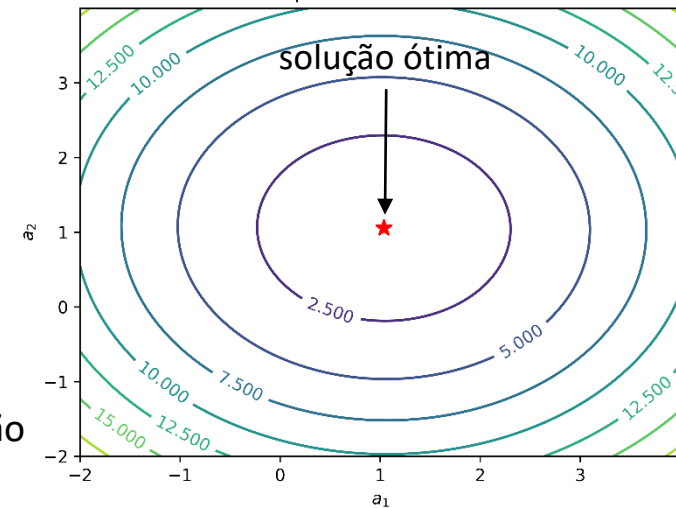
- A segunda figura mostra a **superfície de contorno**.

- Uma linha de contorno de uma função de duas variáveis é uma curva ao longo da qual a função tem um valor constante. Ou seja, no nosso caso, cada uma das linhas indica curvas que têm o mesmo erro

O erro é calculado variando-se  $a_1$  e  $a_2$  na equação do EQM.



Superfície de contorno



# Desvantagens da forma fechada (Eq. Normal)

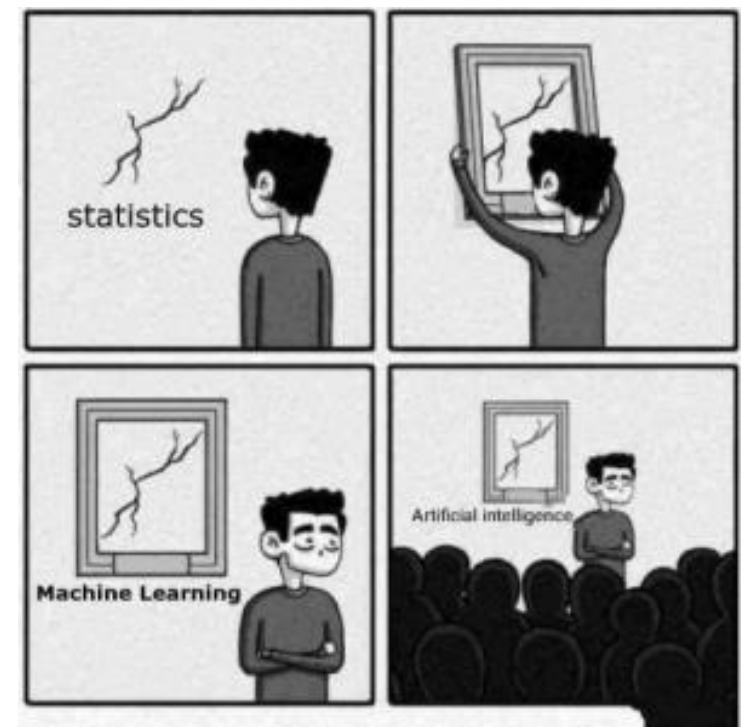
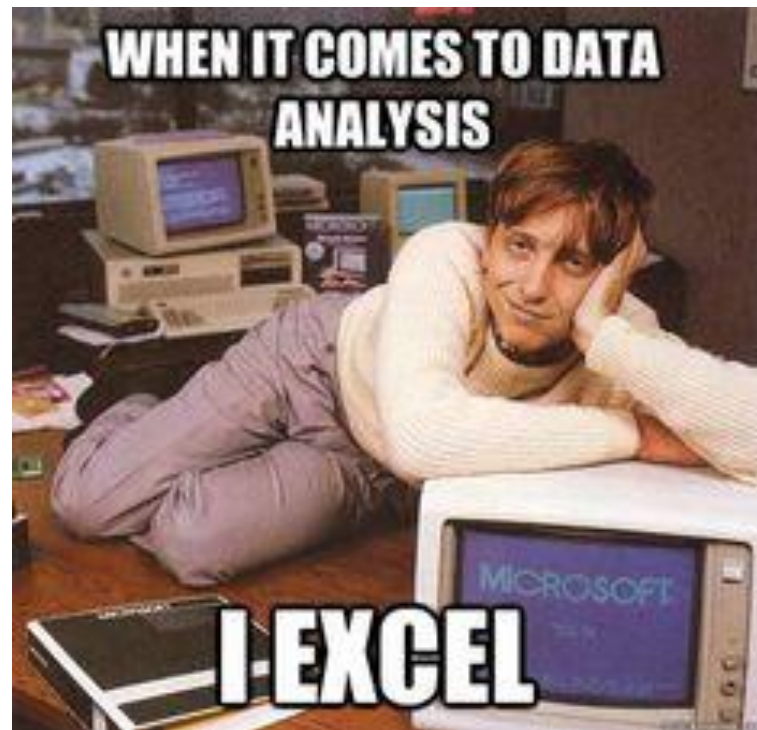
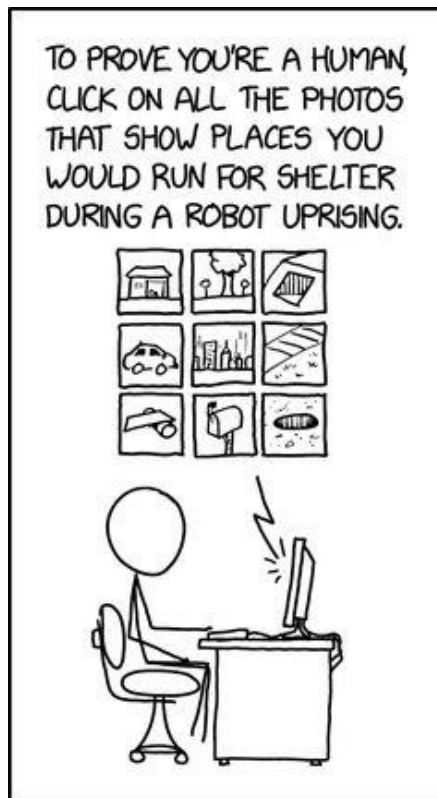
- **Alta complexidade computacional:** a solução da **equação normal** envolve o cálculo da inversa de  $\Phi^T \Phi$ , o qual tem complexidade computacional que varia de  $O(n^{2.4})$  a  $O(n^3)$ .
  - **Ex.:** Se o número de **atributos** dobrar, o tempo para cálculo aumenta de  $2^{2.4} = 5.3$  a  $2^3 = 8$  vezes.
- Dependendo do número de **exemplos**,  $N$ , e **atributos**,  $x$ , a matriz  $\Phi$  pode consumir muita memória.
- **Portanto, essa abordagem não é escalonável!**
- Adicionalmente, para irmos além dos modelos lineares (i.e., regressão não-linear) precisamos lidar com o fato de que não existem formas fechadas como a **equação normal**.
- **Solução:** abordagens iterativas
  - Métodos iterativos de busca que façam a atualização dos parâmetros,  $\alpha$ , à medida que os dados forem sendo apresentados ao modelo.
  - Por exemplo, o algoritmo do **gradiente descendente**, o qual veremos a seguir.

# Tarefas

- **Quiz:** “*T319 - Quiz - Regressão: Parte I (1S2021)*” que se encontra no MS Teams.
- **Exercício Prático:** [Laboratório #2](#).
  - Pode ser baixado do MS Teams ou do GitHub.
  - Pode ser respondido através do link acima (na nuvem) ou localmente.
  - [Instruções para resolução e entrega dos laboratórios](#).

Obrigado!





Albert Einstein: Insanity Is Doing  
the Same Thing Over and Over Again  
and Expecting Different Results

Machine learning:

