

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



Inatel

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

Recapitulando

- Vimos que a escolha do passo de aprendizagem influencia muito no processo aprendizagem do gradiente descendente.
 - Valores pequenos fazem com que o algoritmo tenha convergência muito lenta.
 - Valores grandes fazem com que o algoritmo divirja.
- Gráfico do erro em função das iterações nos ajuda a depurar o algoritmo.
- Além do ajuste manual, quando usamos GDE ou GD em mini-batches, precisamos reduzir o valor do passo de aprendizagem ao longo das iterações para garantir a convergência e estabilização do GD.
- Hoje, veremos
 - um tipo de ***pré-processamento*** bastante importante para algoritmos de ML que usem métricas de distância como função de erro.
 - como aproximar dados que não são lineares, ou seja, que não podem ser aproximados por uma simples reta.

Escalonamento de Atributos

- Dada a seguinte equação hipótese, $h(\mathbf{x})$

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

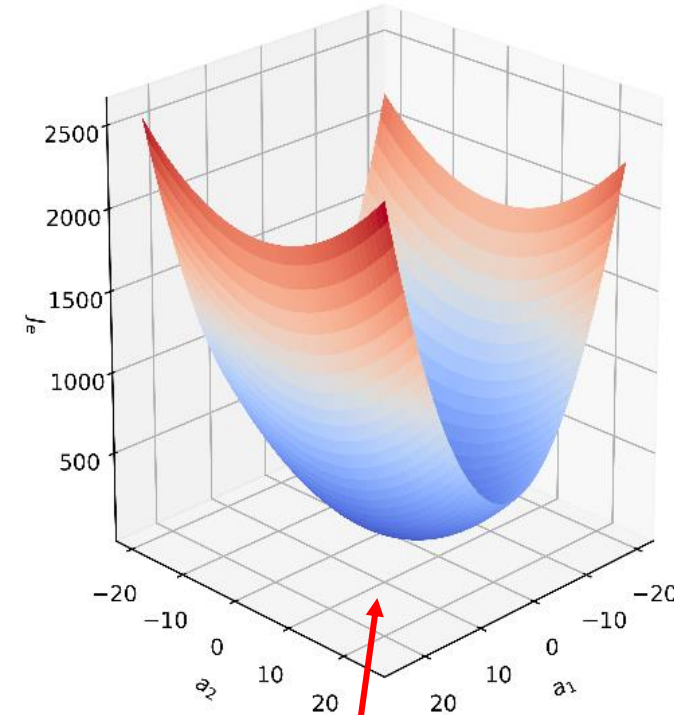
- A função de erro é dada por

$$J_e(\mathbf{a}) = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} [y_{\text{noisy}}(n) - (a_1 x_1(n) + a_2 x_2(n))]^2.$$

- Caso $x_1(n) \gg x_2(n), \forall i$, então $x_1(n)$ tem uma influência maior no erro resultante, o que pode ser expresso de forma aproximada como

$$J_e(\mathbf{a}) \approx \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} [y_{\text{noisy}}(n) - a_1 x_1(n)]^2.$$

- Portanto, o erro entre y_{noisy} e $h(\mathbf{x}(n))$ será dominado pelo atributo $x_1(n)$ e, portanto, pequenas variações de a_1 fazem com que o erro varie rapidamente.
- A diferença entre as magnitudes dos atributos afeta o desempenho de algoritmos de ML que usam métricas de distância como função de erro.
 - As diferenças entre as magnitudes dos atributos faz com que as superfícies de erro tenham formato de vale ('U' ou 'V'), **dificultando a convergência dos algoritmos.**



Escalonamento de Atributos

- O que pode ser feito?
- Para evitar esse problema, o intervalo de variação de todos os **atributos** deve ser **escalonado** para que cada **atributo** contribua com o mesmo **peso** para o cálculo do erro.
- As duas formas mais comuns de escalonamento são:

- **Normalização Mín-Max**

$$x'_k(i) = \frac{x_k(i) - \min(\mathbf{x})}{\max(\mathbf{x}) - \min(\mathbf{x})}, 0 \leq x'_k(i) \leq 1$$

- **Padronização**

$$x'_k(i) = \frac{x_k(i) - \mu_x}{\sigma_x}$$

- **Normalização Mín-Max** faz com que os atributos variem entre 0 e 1.
- **Padronização** faz com que os atributos tenham média zero e desvio padrão unitário. Observe que, neste caso, os valores não ficam restritos a um intervalo específico.
- Vantagens do escalonamento
 - Ajuda a acelerar a convergência do **gradiente descendente** pois deixa as curvas de nível da superfície de erro mais circulares.
 - Possibilita comparar o peso/influência de cada **atributo** no modelo.

Escalonamento de Atributos

Modelo gerador:

$$y(n) = a_1 x_1(n) + a_2 x_2(n),$$

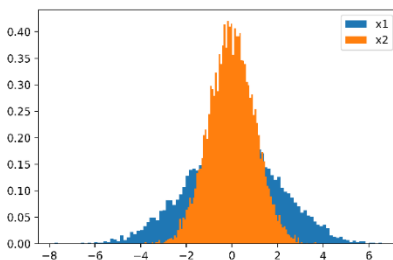
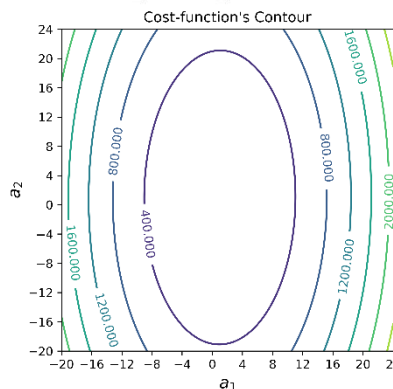
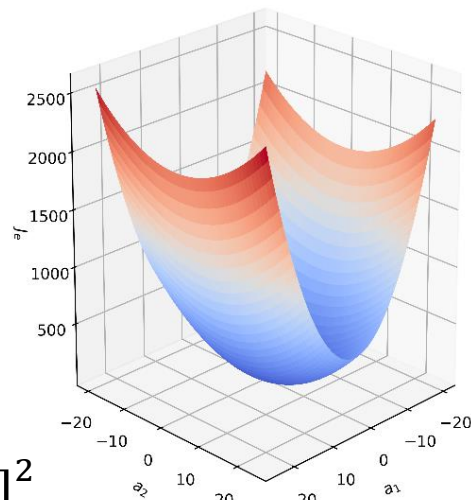
onde $a_1 = 1, a_2 = 1$.

Para plotar a superfície de erro usamos:

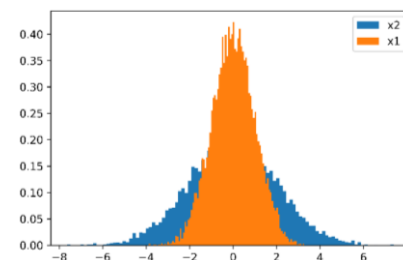
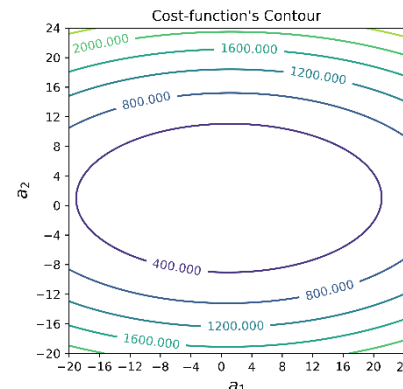
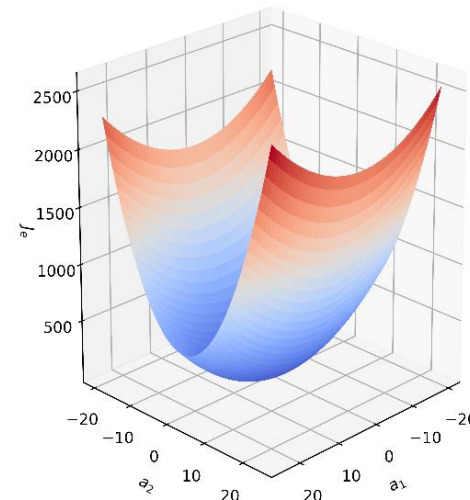
$$J_e(\mathbf{a}) = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} [y_{\text{noisy}}(n) - (\hat{a}_1 x_1(n) + \hat{a}_2 x_2(n))]^2$$

- $x_1 \gg x_2$: erro varia mais rapidamente com variações de \hat{a}_1 , resultando num vale.
- $x_2 \gg x_1$: erro varia mais rapidamente com variações de \hat{a}_2 , resultando também em um vale.
- Quando x_1 e x_2 têm intervalo semelhante, então, a variação tanto de \hat{a}_1 quanto de \hat{a}_2 tem **peso** semelhante na variação do erro (tigela).

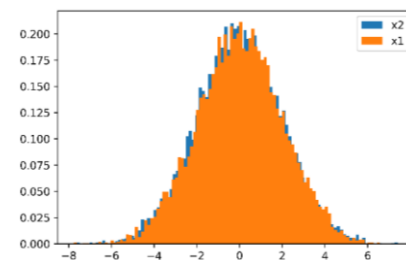
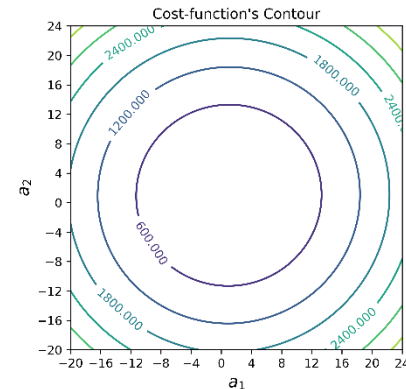
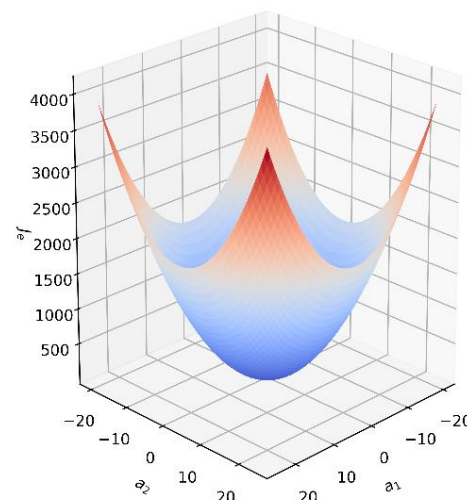
Após padronização



$$x_1 = 2 * \text{randn}(M, 1) \\ x_2 = \text{randn}(M, 1)$$



$$x_1 = \text{randn}(M, 1) \\ x_2 = 2 * \text{randn}(M, 1)$$

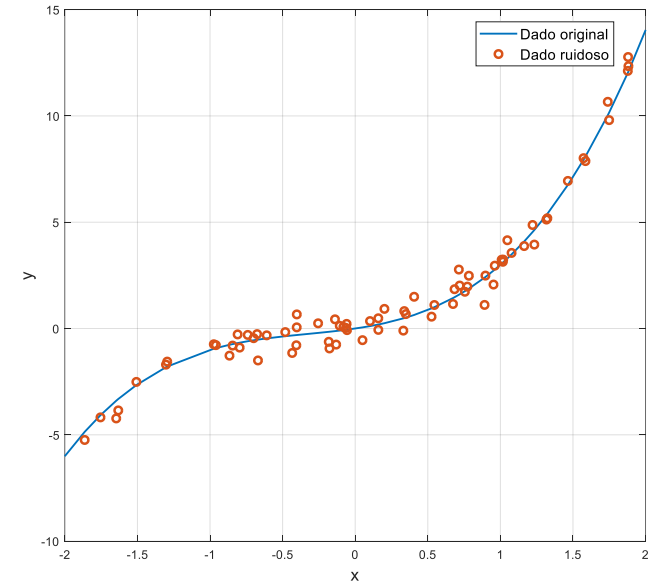
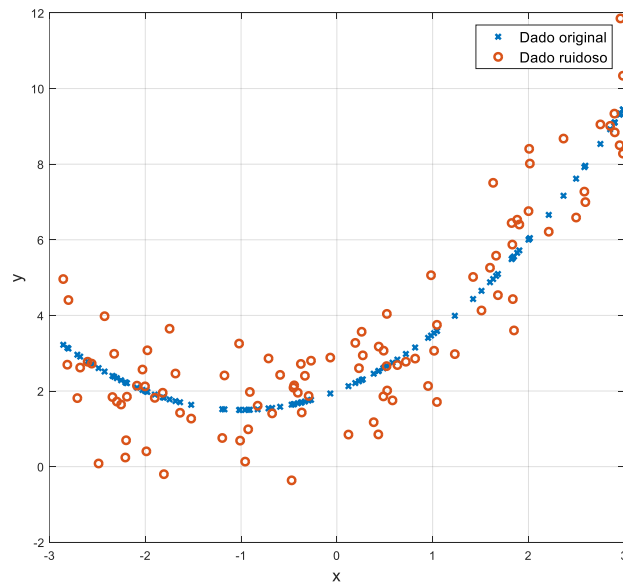
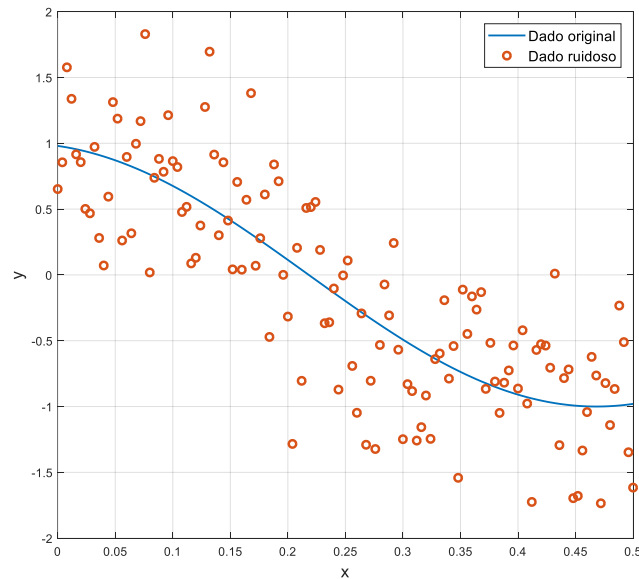


$$x_1 = \text{randn}(M, 1) \\ x_2 = \text{randn}(M, 1)$$

[Exemplo: escalonamento de atributos.ipynb](#)

Regressão Polinomial: Motivação

- E se os dados tiverem um formato mais complexo do que uma simples linha reta?
- Como encontraríamos um modelo que aproxime as funções abaixo?
- Uma reta claramente não seria uma boa escolha.



Regressão Polinomial

- Dados deste tipo podem ser aproximados através de polinômios:
 - “Qualquer função contínua no intervalo fechado $[a, b]$ pode ser uniformemente aproximada tão bem quanto desejado por um polinômio”, **Teorema da aproximação de Weierstrass**.
- Portanto, podemos aproximar dados de qualquer formato com polinômios:
$$y(\mathbf{x}) = a_0 + a_1x_1 + a_2x_2 + a_3x_1x_3 + a_4x_1x_2x_3^2 + a_5x_1^3$$
- Por simplicidade, para nossa análise, nós vamos considerar **funções hipóteses polinomiais em uma variável**

$$h(\mathbf{x}(i)) = \hat{y}(\mathbf{x}(i)) = a_0 + a_1x_1(i) + a_2x_1^2(i) + \cdots + a_Mx_1^M(i).$$

onde M é a ordem do polinômio.

- Todos resultados encontrados anteriormente (equação normal, gradientes para o gradiente descendente, escalonamento) são facilmente estendidos para funções hipótese polinomiais.

Regressão Polinomial: Exemplo

- Geramos 30 exemplos do seguinte mapeamento verdadeiro:

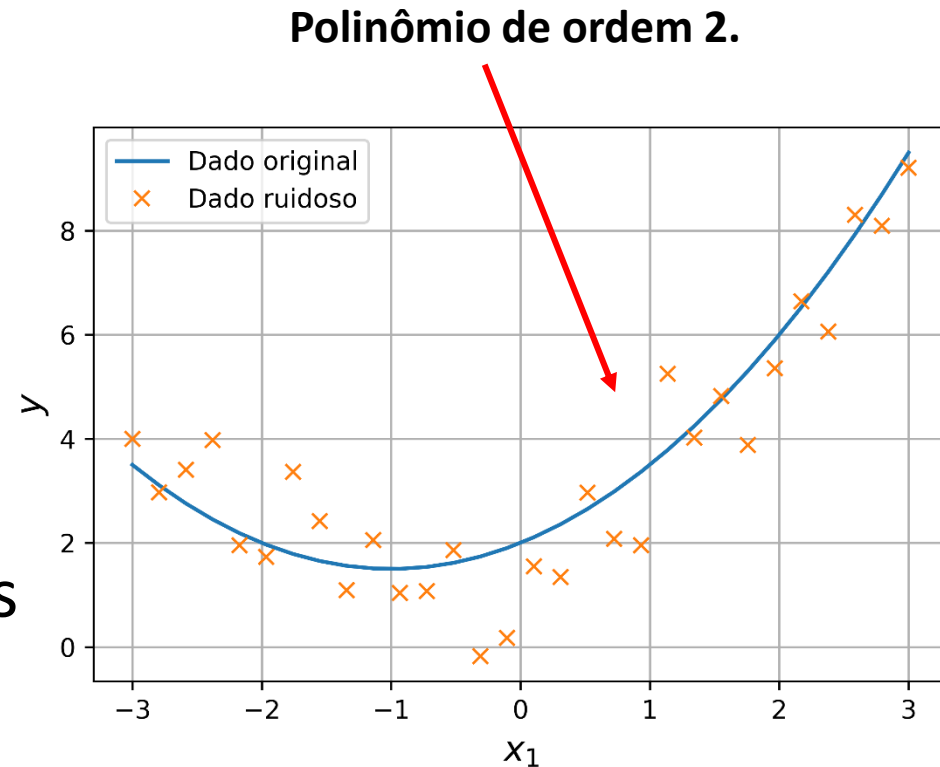
$$y(x_1(n)) = 2 + x_1(n) + 0.5x_1^2(n),$$

e adicionamos ruído Gaussiano branco, $w(n)$

$$y_{\text{noisy}}(x_1(n)) = y(x_1(n)) + w(n),$$

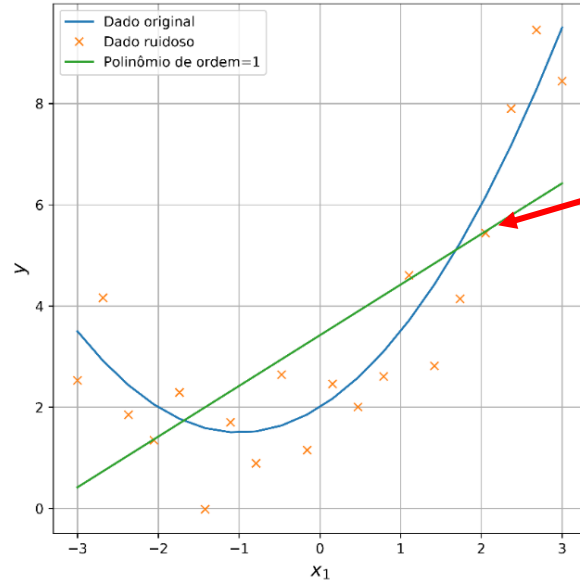
onde $x_1(n)$ são valores linearmente espaçados entre -3 e 3 e $w(n) \sim N(0, 1)$.

- Agora surge uma dúvida, se não soubéssemos a ordem por trás do modelo gerador, qual ordem deveríamos utilizar?



Regressão Polinomial: Qual ordem usar?

Polinômio de ordem 1.



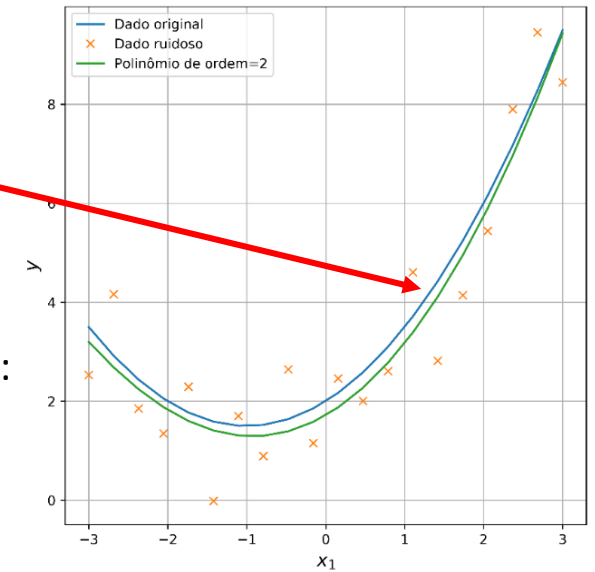
Reta não é flexível o suficiente para se contorcer a aproximar os dados.

Flexibilidade e grau de generalização muito baixos.

Ordem ótima pois é a mesma do modelo gerador.

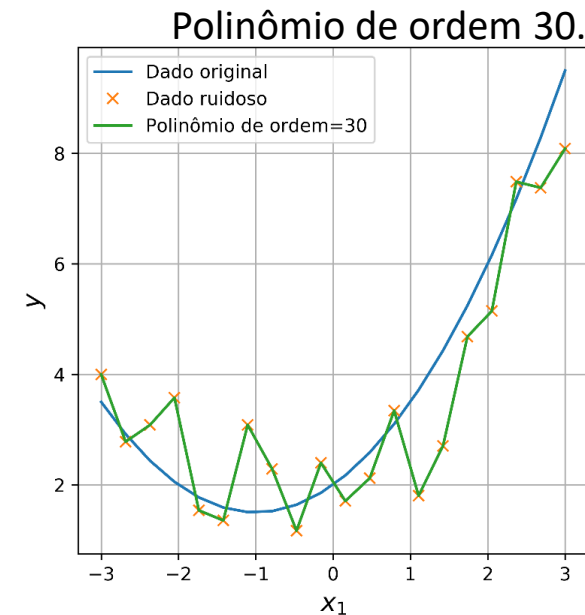
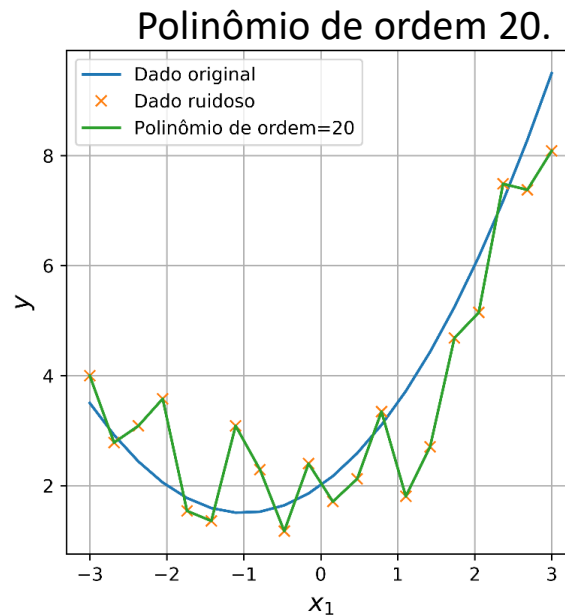
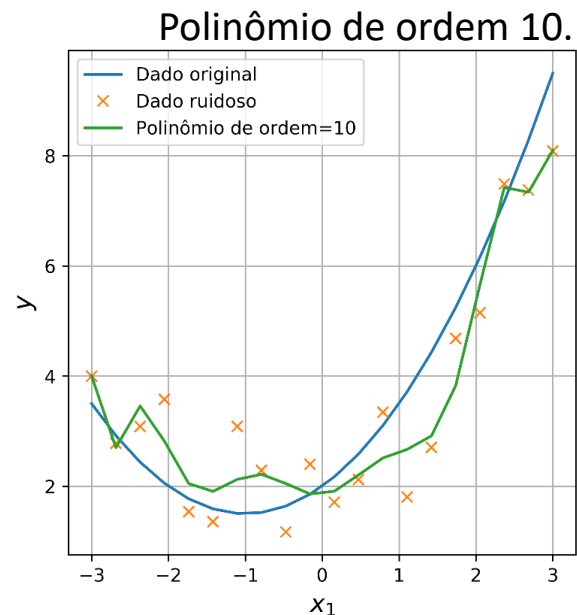
Encontra relação de compromisso entre **flexibilidade** e **generalização**: **flexibilidade e grau de generalização** médios.

Polinômio de ordem 2.



- Polinômio de ordem 1 não tem flexibilidade o suficiente para aproximar bem os dados.
- O modelo erra muito tanto para predição dos exemplos de treinamento quanto para exemplos de validação (ou seja, exemplos não vistos durante o treinamento).
- Efeito conhecido como **subajuste** ou **underfitting**: **flexibilidade e grau de generalização** muito baixos.
- Porém, como esperado, o polinômio de ordem 2 produz a melhor aproximação dos dados, errando pouco para exemplos de treinamento e validação.
 - Essa aproximação será melhor quanto maior for o conjunto de treinamento e/ou menor o ruído.

Regressão Polinomial: Qual ordem usar?



- Polinômios com ordem > 2 tendem a produzir ***aproximações perfeitas*** dos exemplos disponíveis, ou seja, o modelo acaba ***memorizando*** os exemplos de treinamento.
- Porém, essa aproximação se distancia bastante do modelo gerador.
- Portanto, esses modelos apresentarão erros grandes quando forem apresentados a exemplos de validação.
- Efeito conhecido como ***sobreajuste*** ou ***overfitting***: ***flexibilidade*** muito alta e ***grau de generalização*** muito baixo.

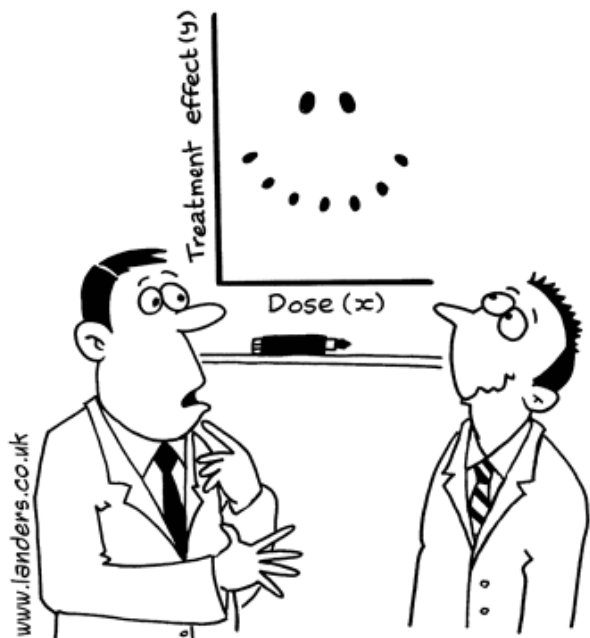
Subajuste e sobreajuste: Resumo

- **Subajuste:** situação em que o modelo falha em aproximar o ***mapeamento verdadeiro***. Isto pode ocorrer devido ao baixo grau de complexidade do modelo ou por problemas de convergência durante o treinamento.
 - Se o modelo está subajustando, mesmo que o número de exemplos aumente indefinidamente, esta situação não vai desaparecer, é necessário aumentar a flexibilidade do modelo, ou seja, no caso da regressão polinomial, sua ordem.
- **Sobreajuste:** situação em que o modelo se ajusta tão bem aos exemplos de treinamento que ele aprende até o ruído presente nos mesmos (baixo ***erro de treinamento***). Porém, o modelo produz erros significativos quando apresentado a dados inéditos (alto erro de ***erro de validação***).
 - Se o modelo está sobreajustando, então é necessário diminuir sua flexibilidade ou aumentar o conjunto de treinamento até que o erro de validação atinja o erro de treinamento.

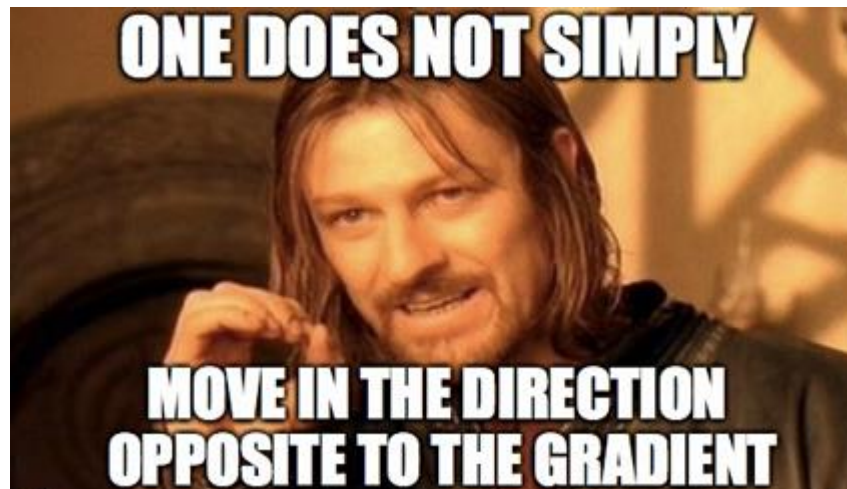
Tarefas

- **Quiz:** “*T319 - Quiz - Regressão: Parte IV (1S2021)*” que se encontra no MS Teams.
- **Exercício Prático:** [Laboratório #5](#).
 - 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](#).
 - **Laboratórios podem ser feitos em grupo.**

Obrigado!



"It's a non-linear pattern with outliers.....but for some reason I'm very happy with the data."



MY HOBBY: EXTRAPOLATING

