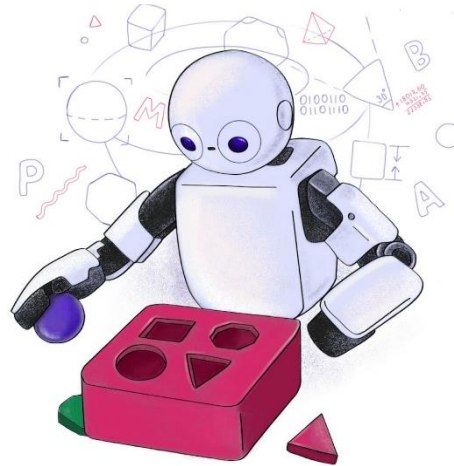


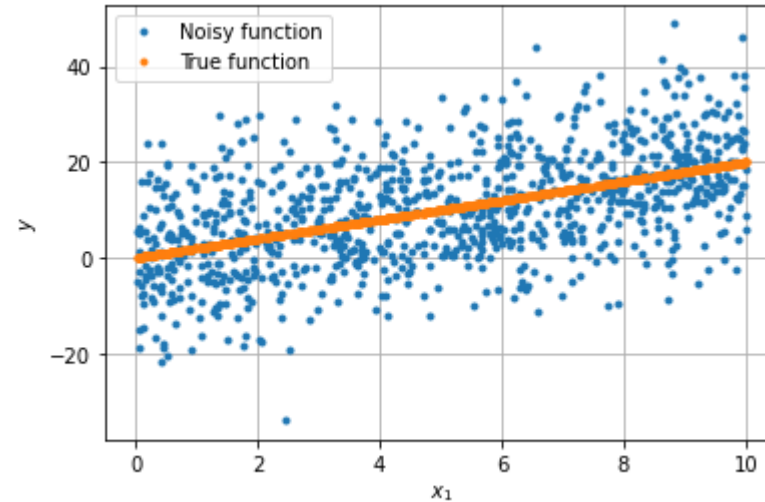
# TP555 - Inteligência Artificial e Machine Learning: *Exemplos de implementação do gradiente descendente*



***Inatel***

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

# Exemplo #1



- De posse dos dados ruidosos mostrados na figura acima, encontrar com o ***gradiente descendente*** os pesos de uma função,  $h(\mathbf{x})$ , que aproxime a função objetivo.
- Para facilitar nossa análise, vamos simplificar um pouco e usar uma ***função hipótese*** com apenas um peso,  $\hat{a}_1$ :
$$\hat{y}(n) = h(x_1(n)) = \hat{a}_1 x_1(n).$$
- Qual é a regra de atualização para o peso  $\hat{a}_1$ ?

- **Dicas:**

- Comecem substituindo  $\hat{y}(n)$  em  $J_e(\mathbf{a}) = \frac{1}{N} \|\mathbf{y} - \hat{\mathbf{y}}\|^2 = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} (y(n) - \hat{y}(n))^2$ .
- Lembrem-se que a operação da derivada parcial é distributiva.

# Exemplo #1

[Exemplo 1: linear regression with gradient descent exemplo1.ipynb](#)

Para facilitar nossa análise, vamos simplificar um pouco e usar uma **função hipótese** com apenas um peso

$$\hat{y}(n) = h(x_1(n)) = \hat{a}_1 x_1(n).$$

Com **função de erro** dada por

$$J_e(\hat{a}_1) = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} (y(n) - \hat{a}_1 x_1(n))^2.$$

Operação da derivada parcial é distributiva.

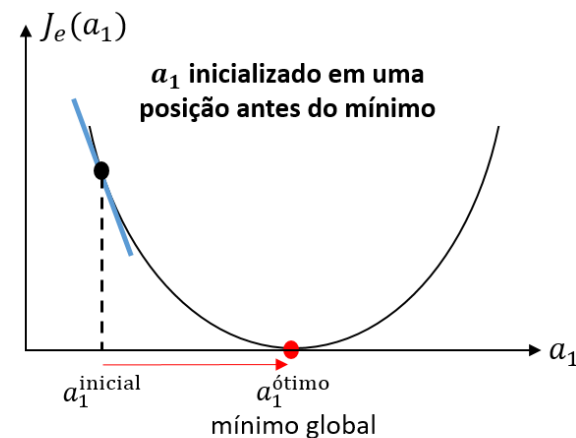
Gradiente dado por

$$\begin{aligned} \frac{\partial J_e(\hat{a}_1)}{\partial \hat{a}_1} &= \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} \frac{\partial (y(n) - \hat{a}_1 x_1(n))^2}{\partial \hat{a}_1} \\ &= -\frac{2}{N} \sum_{n=0}^{N-1} (y(n) - \hat{a}_1 x_1(n)) x_1(n) \end{aligned}$$

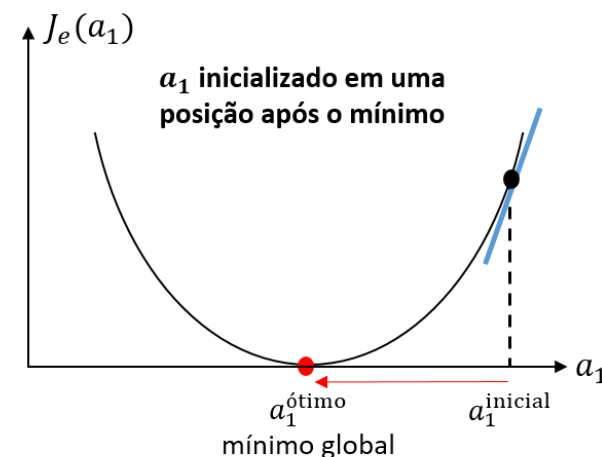
E atualização do peso  $\hat{a}_1$  dada por

$$\hat{a}_1 = \hat{a}_1 - \alpha \frac{\partial J_e(\hat{a}_1)}{\partial \hat{a}_1} \therefore \hat{a}_1 = \hat{a}_1 + \alpha \sum_{n=0}^{N-1} (y(n) - \hat{a}_1 x_1(n)) x_1(n),$$

onde o termo  $\frac{2}{N}$  foi absorvido pelo **passo de aprendizagem**,  $\alpha$ .

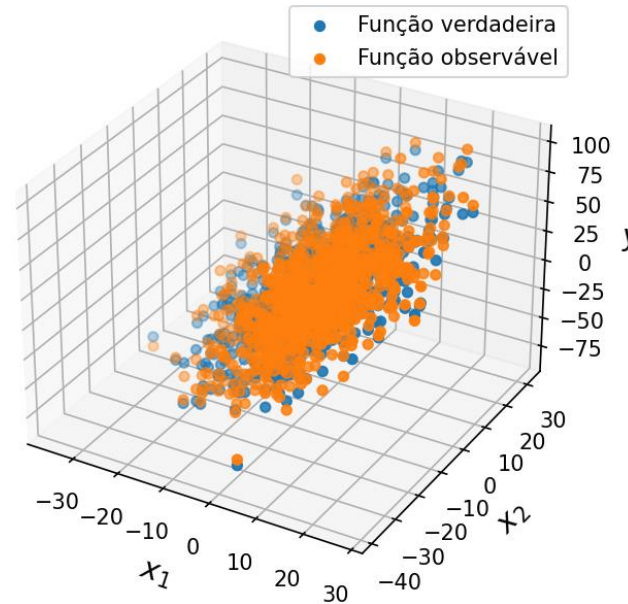


**gradiente negativo:**  $a_1 = a_1^{\text{inicial}} + \alpha \nabla J_e(a_1)$   
 $a_1$  aumenta e se aproxima do mínimo



**gradiente positivo:**  $a_1 = a_1^{\text{inicial}} - \alpha \nabla J_e(a_1)$   
 $a_1$  diminui e se aproxima do mínimo

## Exemplo #2



- De posse dos dados ruidosos mostrados na figura acima, encontrar com o ***gradiente descendente*** os pesos de uma função,  $h(\mathbf{x})$ , que aproxime a função objetivo.
- Neste exemplo, vamos usar uma ***função hipótese*** com 2 pesos,  $\hat{a}_1$  e  $\hat{a}_2$ , onde  $\hat{a}_0 = 0$

$$\hat{y}(n) = h(\mathbf{x}(n)) = \hat{a}_1 x_1(n) + \hat{a}_2 x_2(n).$$

- Qual é a regra de atualização para os pesos  $\hat{a}_1$  e  $\hat{a}_2$ ?

- **Dicas:**

- Comecem substituindo  $\hat{y}(n)$  em  $J_e(\mathbf{a}) = \frac{1}{N} \|\mathbf{y} - \hat{\mathbf{y}}\|^2 = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} (y(n) - \hat{y}(n))^2$ .
- Lembrem-se que a operação da derivada parcial é distributiva.

# Exemplo #2

[Exemplo 2: linear regression with gradient descent exemplo2.ipynb](#)

Neste exemplo, usaremos uma **função hipótese** com 2 pesos,  $\hat{a}_1$  e  $\hat{a}_2$ , sendo  $\hat{a}_0 = 0$

$$\hat{y}(n) = h(\mathbf{x}(n)) = \hat{a}_1 x_1(n) + \hat{a}_2 x_2(n).$$

A função de erro é dada por

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

Operação da derivada parcial é distributiva.

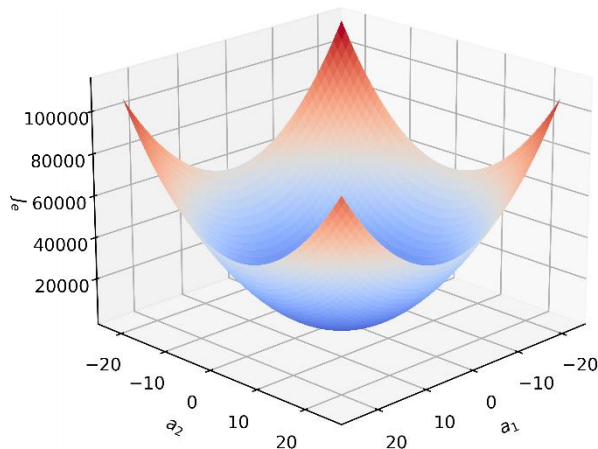
Cada elemento do vetor gradiente é dado por

$$\frac{\partial J_e(\mathbf{a})}{\partial \hat{a}_k} = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} \frac{\partial [y(n) - (\hat{a}_1 x_1(n) + \hat{a}_2 x_2(n))]^2}{\partial \hat{a}_k} = -\frac{2}{N} \sum_{n=0}^{N-1} [y(n) - (\hat{a}_1 x_1(n) + \hat{a}_2 x_2(n))] x_k(n), \quad k = 1, 2,$$

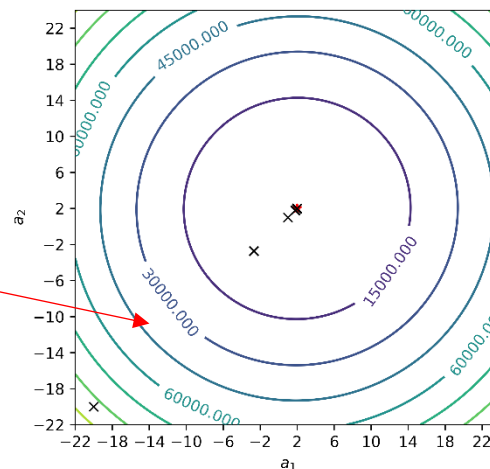
A atualização dos pesos  $a_k$ ,  $k = 1$  e  $2$  é dada por

$$\hat{a}_k = \hat{a}_k - \alpha \frac{\partial J_e(\mathbf{a})}{\partial \hat{a}_k} \therefore \hat{a}_k = \hat{a}_k + \alpha \sum_{n=0}^{N-1} [y(n) - (\hat{a}_1 x_1(n) + \hat{a}_2 x_2(n))] x_k(n), \quad k = 1, 2.$$

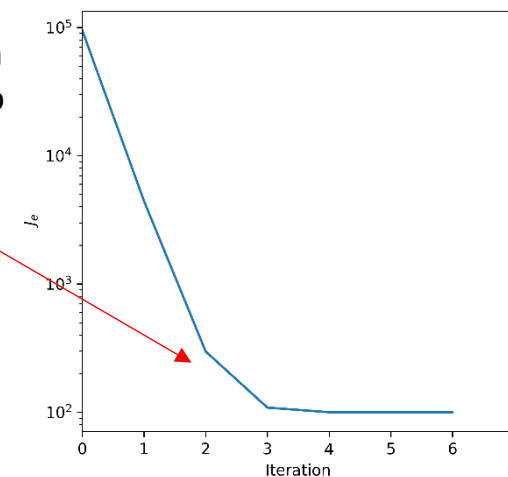
onde o termo  $\frac{2}{N}$  foi absorvido pelo **passo de aprendizagem**,  $\alpha$ .



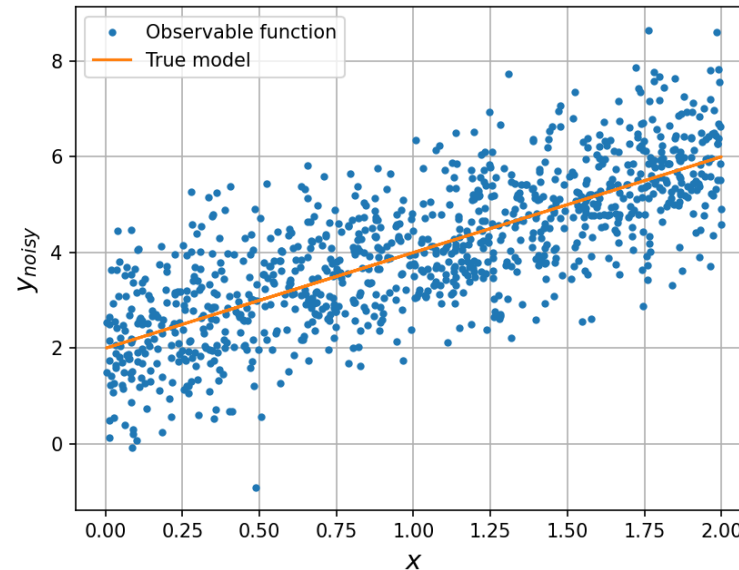
Superfície de contorno com o caminho feito pelo algoritmo até a convergência.



Curva do EQM em função do número de épocas.



# Exemplo #3



- De posse dos dados ruidosos mostrados na figura acima, encontrar com o ***gradiente descendente*** os pesos de uma função,  $h(\mathbf{x})$ , que aproxime a função objetivo.
- Neste exemplo, vamos usar uma ***função hipótese*** com 2 pesos,  $\hat{a}_0$  e  $\hat{a}_1$ ,
$$\hat{y}(n) = h(\mathbf{x}(n)) = \hat{a}_0 + \hat{a}_1 x_1(n).$$
- Qual é a regra de atualização para os pesos  $\hat{a}_0$  e  $\hat{a}_1$ ?
  - **Dicas:**
    - Comecem substituindo  $\hat{y}(n)$  em  $J_e(\mathbf{a}) = \frac{1}{N} \|\mathbf{y} - \hat{\mathbf{y}}\|^2 = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} (y(n) - \hat{y}(n))^2$ .
    - Lembrem-se que a operação da derivada parcial é distributiva.

# Exemplo #3

[Exemplo 3: linear regression with gradient descent exemplo3.ipynb](#)

**Função hipótese** com 2 pesos,  $\hat{a}_0$  e  $\hat{a}_1$ ,

$$\hat{y}(n) = h(\mathbf{x}(n)) = \hat{a}_0 + \hat{a}_1 x_1(n).$$

A **função de erro** é dada por

$$J_e(\mathbf{a}) = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} [y(n) - (\hat{a}_0 + \hat{a}_1 x_1(n))]^2.$$

Operação da derivada parcial é distributiva.

E a atualização dos pesos  $\hat{a}_k$ ,  $k = 0$  e  $1$  é dada por

$$\frac{\partial J_e(\mathbf{a})}{\partial \hat{a}_k} = \frac{1}{N} \sum_{n=0}^{N-1} \frac{\partial [y(n) - (\hat{a}_0 + \hat{a}_1 x_1(n))]^2}{\partial \hat{a}_k} = -\frac{2}{N} \sum_{n=0}^{N-1} [y(n) - (\hat{a}_0 + \hat{a}_1 x_1(n))] x_k(n),$$

$k = 0, 1,$

$$\hat{a}_k = \hat{a}_k - \alpha \frac{\partial J_e(\mathbf{a})}{\partial \hat{a}_k} \therefore \hat{a}_k = \hat{a}_k + \alpha \sum_{n=0}^{N-1} [y(n) - (\hat{a}_0 + \hat{a}_1 x_1(n))] x_k(n), \quad k = 0, 1,$$

onde  $x_0(n) = 1, \forall n$ .

o termo  $\frac{2}{N}$  foi absorvido pelo **passo de aprendizagem**,  $\alpha$

**OBS.1:** Temos o termo de bias/intercept nesta função hipótese, portanto, não se esqueçam da coluna de '1's (*vetor do atributo de bias*) na implementação do código.

**OBS.2:** Para executar este exemplo, é necessário instalar a biblioteca ffmpeg com o comando:  
`conda install ffmpeg`

# Exemplo #4: GDE com Scikit-Learn

[Exemplo: SGD with scikit learn lib.ipynb](#)



- A classe ***SGDRegressor***, da biblioteca ***Scikit-Learn***, implementa o ***gradiente descendente estocástico***.
- A classe possui vários ***hiperparâmetros*** que podem ser configurados (tipo de função de erro, esquema de variação do passo de aprendizagem, penalização, etc.).
  - **Hiperparâmetro**: parâmetro que controla o processo de aprendizagem.
- A ***função de erro*** pode ser configurada entre várias opções, mas por padrão, a classe usa o ***erro quadrático médio***.
- É possível definir o ***esquema de variação do passo de aprendizagem***: constante, redução programada ou adaptativo.
- Por padrão, o esquema é o da escala inversa, ***“invscaling”***

$$\alpha = \frac{\alpha_{init}}{i^{power}},$$

- onde  $\alpha_{init}$  é o passo inicial (por padrão = 0.01),  $i$  é o número da iteração e  $power$  é o expoente da escala inversa (por padrão = 0.25).
- Porém, não conseguimos implementar as versões em batelada e mini-batch.