

Co bude v dnešní přednášce

- Ensemble metody – základní myšlenka
- Bagging – náhodné lesy
- Boosting – AdaBoost

11 Ensemble metody obecně

Ensemble metody: základní myšlenka

- Základní myšlenka spočívá v tom, že namísto jednoho modelu (např. rozhodovacího stromu) použijeme **více modelů** a jejich predikce nějakým způsobem zkombinujeme do finálního rozhodnutí.
- My si ukážeme dva nejobvyklejší způsoby: **Bagging = bootstrap aggregating** a **Boosting**.
- Každý z těchto dvou přístupů si ilustrujeme na nejznámějších reprezentantech, které navíc spočívají ve skládání rozhodovacích stromů, které už známe z minulé přednášky.
- Tyto dva reprezentanti jsou **Náhodné lesy** (angl. **Random Forest**) a **AdaBoost** (Adaptive Boosting).

12 Bagging: náhodné lesy

Náhodný les pro klasifikaci: základní myšlenka

Pro jednoduchost předpokládejme, že máme binární klasifikační problém, tj. rozhodujeme jestli $Y = 0$ nebo $Y = 1$.

1. Ze vstupního trénovacího datasetu \mathcal{D} vytvoříme n datasetů $\mathcal{D}_1, \dots, \mathcal{D}_n$ obvykle stejně velkých (mohou být i větší či menší) jako \mathcal{D} pomocí metody **bootstrap**, neboli (středoškolsky) pomocí výběru *s opakováním*.
2. Na každém datasetu \mathcal{D}_i naučíme rozhodovací strom tak, jak jsme si předvedli v minulé přednášce. Může být málo hluboký, klidně hloubky (parametr `max_depth`) dva nebo tři (používá se i hloubka jedna). Označme tyto stromy T_1, \dots, T_n .
3. Každý datový bod (tj. řádek z tabulky s daty \mathcal{D}) proženeme všemi stromy T_1, \dots, T_n a od každého z nich si uložíme rozhodnutí Y_1, \dots, Y_n .
4. Všechny tyto stromy T_1, \dots, T_n tvoří **náhodný les** a jeho finální rozhodnutí o hodnotě Y je dané většinovým rozhodnutím stromů, je-li např. v množině $\{Y_1, \dots, Y_n\}$ více jedniček než nul, je predikce náhodného lesa $Y = 1$.

Bootstrap

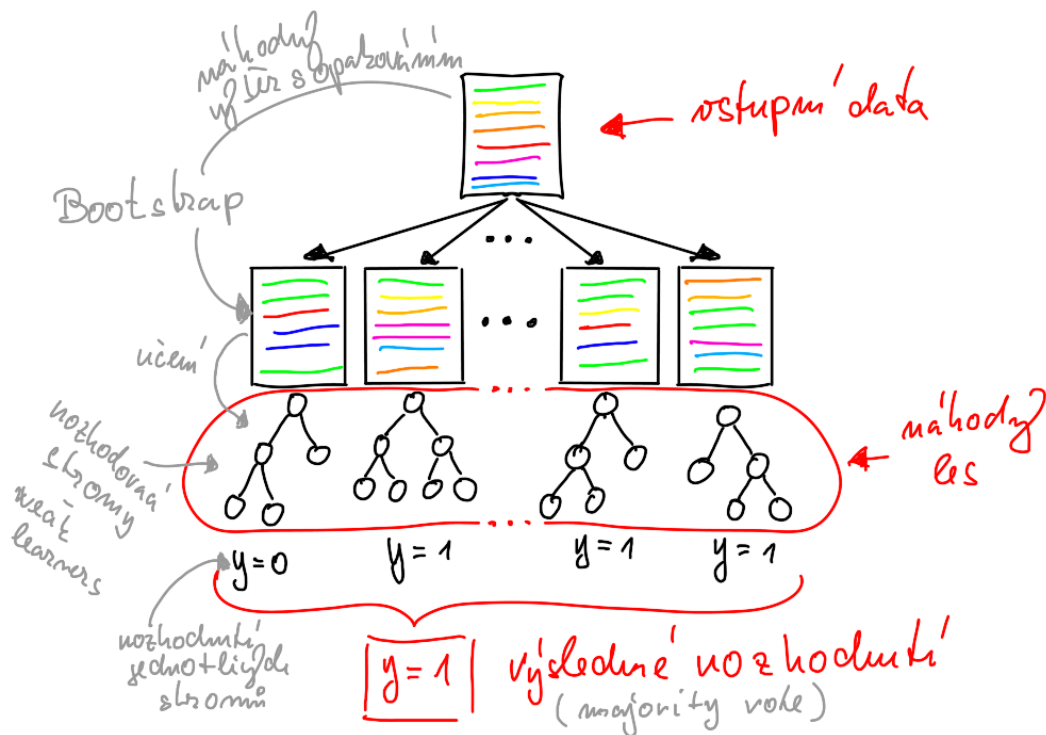
Ukážeme si, jak funguje *bootstrap* na jednoduchém příkladu a našem rýmičkovém datasetu:

id	rýmička	pohlaví	> 39°C	vstal(a)?
1	ano	muž	ne	ne
2	ne	žena	ano	ano
3	ne	muž	ne	ano
4	ano	žena	ano	ne

Chceme-li vytvořit „bootstrap“ dataset velikosti pět, pětkrát si **náhodně vybereme řádek s tabulky** s tím, že se řádky v našem výběru **mohou opakovat**. Vybereme-li např. řádky s id 1,4,3,3,1, dostaneme dataset

id	rýmička	pohlaví	> 39°C	vstal(a)?
1	ano	muž	ne	ne
4	ano	žena	ano	ne
3	ne	muž	ne	ano
3	ne	muž	ne	ano
1	ano	muž	ne	ne

Náhodný les pro klasifikaci: základní myšlenka na obrázku



Poznámky (1/2)

- Základními parametry metod `RandomForestClassifier` a `RandomForestRegressor` v `sklearn` jsou:
 - `n_estimators`: určuje počet stromů v náhodném lese,
 - `max_depth`: určuje maximální hloubku stromů v lese (je lepší použít nízkou hodnotu),
 - `max_features`: počet (náhodně vybraných) příznaků, ze kterých si hladový algoritmus vybírá ten, podle kterého bude v aktuálním kroku data „větvit“.
- Tyto metody mají také mnoho shodných parametrů s analogickými metodami pro jednoduché rozhodovací stromy; tyto parametry se přenáší na jednotlivé stromy v náhodném lese.
- V případě regresního problému (spojité Y) se postupuje opět analogicky jako u regresních rozhodovacích stromů: predikce náhodného lesa se bere jako průměr z predikcí jednotlivých stromů lesa.

Poznámky (2/2)

- U ensemble metod, které skládají rozhodnutí z více modelů, je důležité, aby jednotlivé modely nebyly stejné ale naopak co nejpestřejší.

- Toho se většinou docílí nějakým druhem „randomizace“; v případě náhodných lesů je tento náhodný prvek daný bootstrap metodou pro generování jednotlivých trénovacích datasetů a také hodnotou parametru `max_features`.
- Jak jsme si řekli, rozhodovací stromy jsou velice citlivé na změny v trénovacích datech, a tak často stačí odlišnost datasetů daná bootstrapem, abychom získávali velice odlišné rozhodovací stromy.
- Přestože mohou být jednotlivé stromy samy o sobě slabé modely (podmodelům v ensemble metodách se říká *weak learners*), jejich kolektivní rozhodování dává až překvapivě dobré výsledky.
- Náhodné lesy jsou na rozdíl od rozhodovacích stromů velice robustní a poměrně odolné vůči přeučení. Bohužel ale částečně ztrácejí jejich jednoduchost a snadnou interpretovatelnost.

13 Boosting

Rozhodovací stromy s `sample_weight` (1/2)

- Abychom mohli vysvětlit, jak funguje algoritmus AdaBoost, potřebujeme pochopit použití vážených dat u rozhodovacích stromů.
- V řeči `sklearn` se jedná o použití parametru `sample_weight` v metodě `.fit(X,y,sample_weight)` tříd `DecisionTreeClassifier` a `DecisionTreeRegressor`.
- Pokud máme v trénovacích datech N dat (řádků v tabulce, poloangl. „samplů“), je proměnná `sample_weight` pole $[w_0, w_1, \dots, w_{N-1}]$ vah jednotlivých bodů, obvykle **znormovaných na jedničku**, tj.

$$\sum_{i=0}^{N-1} w_i = 1.$$

Rozhodovací stromy s `sample_weight` (2/2)

- Při učení stromu se váhy projeví v kroku, ve kterém se počítá informační zisk (resp. Gini index)

$$H(\mathcal{D}) - t_L H(\mathcal{D}_L) - t_R H(\mathcal{D}_R)$$

kde $t_L = \frac{\#\mathcal{D}_L}{\#\mathcal{D}}$ a $t_R = \frac{\#\mathcal{D}_R}{\#\mathcal{D}}$.

- Konkrétně se přepočítá hodnota t_L a t_R , tedy velikosti množin dat vzniklých rozdělením \mathcal{D} : Hodnota t_L je rovna součtu vah bodů, které spadají do \mathcal{D}_L , poděleném sumou vah všech bodů z \mathcal{D} . Analogicky pro t_R .
- Jsou-li např. v \mathcal{D}_L body z řádků s indexy 3, 10, 15, 25 a v \mathcal{D} body s indexy 3, 10, 15, 17, 21, 25, je hodnota

$$t_L = \frac{w_3 + w_{10} + w_{15} + w_{25}}{w_3 + w_{10} + w_{15} + w_{17} + w_{21} + w_{25}}$$

Výsledkem použití vah je to, že strom se učí tak, aby správně predikoval zejména datové body s vyšší vahou. (Toto si rozmyslete!)

AdaBoost (Adaptive Boosting): základní myšlenka

- Stejně jako při Baggingu konstruujeme více modelů (opět uvažujeme rozhodovací stromy, i když AdaBoost může používat i jiné typy modelů) a finální rozhodnutí je (váženou) kompozicí rozhodnutí jednotlivých modelů.

- Na rozdíl od Baggingu ale při Boostingu nejsou tyto modely nezávislé, ale jsou seřazené a každý další je ovlivněn těmi předchozími.
- Tento vliv je při AdaBoostu realizován pomocí vah datových bodů: **Při konstrukci n tého stromu je zvýšena váha těm bodům, které předchozí $(n - 1)$ tý strom klasifikoval špatně.**
- Takovýmito změnami vah je zajištěno, že se další model soustředí více na ty datové body, se kterými si předchozí modely neporadily.
- Přibližně takto funguje Boosting obecně, my si dále ukážeme konkrétní implementaci této myšlenky známou jako algoritmus AdaBoost [Freund, Schapire (1997)].

AdaBoost (Adaptive Boosting): popis algoritmu (1/3)

- Na začátku máme dataset \mathcal{D} s N datovými body.
- Pro jednoduchost opět uvažujeme binární klasifikaci. Existují ale i modifikace algoritmu pro více než dvě třídy a i pro regresi.
- Počet zkonstruovaných stromů je zadán uživatelem v parametru `n_estimators`.

AdaBoost:

1. Nastavme váhy rovnoměrně, tedy $w_i = \frac{1}{N}$ a položme $m = 1$.
2. Pokud $m \leq \text{n_estimators}$, naučme strom $T^{(m)}$ na datech \mathcal{D} s váhami w_i .
3. Do proměnné $e^{(m)}$ uložíme součet vah těch bodů z \mathcal{D} , které jsou špatně klasifikované stromem $T^{(m)}$.
4. Pokud je $e^{(m)} = 0$ skončíme, všechna data jsou klasifikována správně.

AdaBoost (Adaptive Boosting): popis algoritmu (2/3)

5. Položíme

$$\alpha^{(m)} = \text{learning_rate} \cdot \log \frac{1 - e^{(m)}}{e^{(m)}},$$

kde `learning_rate` je hyperparametr zadaný uživatelem; používá se ke zpomalení trénování a k zabránění přeučení (je-li menší než jedna).

6. Pro stromem $T^{(m)}$ špatně klasifikované body nastavme nové váhy¹

$$w_i \leftarrow w_i \exp(\alpha^{(m)}).$$

7. Znормalizujeme váhy tak, aby jejich součet byl jedna.
8. Zvětšíme m o jedna a vraťme se do bodu 2.

Výsledkem algoritmu je tedy až `n_estimators` rozhodovacích stromů $T^{(1)}, T^{(2)}, \dots$

AdaBoost (Adaptive Boosting): popis algoritmu (3/3)

Abychom určili rozhodnutí tohoto modelu pro nějaký datový bod x , postupujeme následovně:

1. Každému stromu $T^{(m)}$ přiřadíme váhu danou číslem $\alpha^{(m)}$ z kroku 5.
2. Sečti váhy $\alpha^{(m)}$ všech stromů, které pro x predikují $Y = 1$ a to samé udělej pro stromy predikující $Y = 0$.
3. Rozhodni se pro tu z možností, pro kterou je součet vah vyšší.

¹Výraz $\exp(x)$ značí staré známé e^x . Často se to v literatuře zapisuje takto, tak si zvykejte ;).

AdaBoost (Adaptive Boosting): poznámky

- Verze algoritmu pro „více než binární“ klasifikaci se nazývá *AdaBoost-SAMME* [Zhu, Rosset, Zou, Hastie (2006)]. Tato verze je implementována v `sklearn`.
- Varianta pro regresi se zase nazývá *AdaBoost.R2* [Drucker (1997)].
- AdaBoost nemusí nutně používat rozhodovací stromy; je možné použít jakýkoli model, který umí pracovat s parametrem `sample_weight`.
- V `sklearn` implementaci jsou rozhodovací stromy (hloubky 3) výchozí volba (parametr `base_estimator`).
- Parametr `learning_rate` je obvykle zaváděn u většiny ensemble metod spadajících do kategorie Boostingu.
- Jedná se o tzv. **regularizaci**: čím je `learning_rate` nižší, tím je model odolnější vůči přeučení. Nevýhodou je, že je pak obvykle nutné zvýšit počet stromů (parametr `n_estimators`).

ChangeLog

Verze	Datum	Autor	Log
1.0	15.09.2018	KK	Výchozí verze pro rok 2018/2019.
1.1	08.10.2019	KK	Výchozí verze pro rok 2019/2020.
1.2	08.10.2020	KK	Výchozí verze pro rok 2020/2021.
1.3	29.09.2021	KK	Výchozí verze pro rok 2021/2022.