

Яндекс

Matrixnet

Андрей Гулин
Конспиролог

Москва, 27.02.2010

Линейная регрессия

- Дано: K N -мерных сэмплов $\{x_i\}$ для каждого известно значение функции $\{f_i\}$
- Найти: вектор a , такой что $a^T x_i = f_i$
- Решение: $a = (X^T X)^{-1} X^T f$

Регуляризация

- Когда данных мало простое решение не работает
- Нужна какая-то дополнительная информация, например, мы можем сказать, что мы хотим “маленький” или “простой” вектор a
- Меры простоты:
 - L0 = feature selection
 - L1 = lasso
 - L2 = ridge = по Тихонову [$a=(X^T X+\lambda I)^{-1}X^T f$]

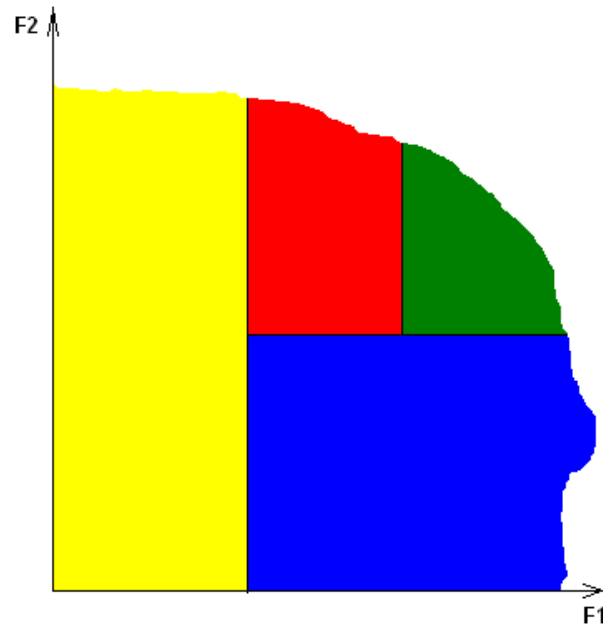
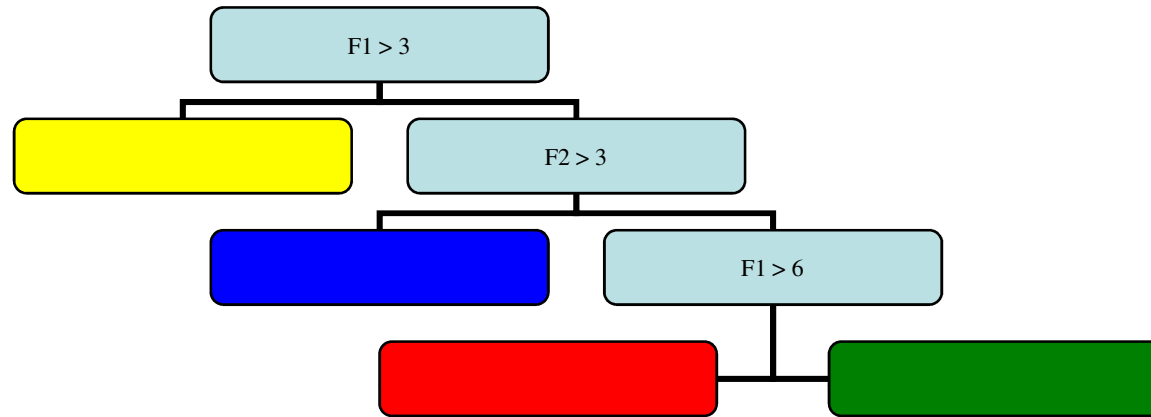
L1 регуляризация

- Итеративный алгоритм L1 регуляризации
- У нас есть текущий “остаток” r_i , который в начале равен f_i
- На каждой итерации мы
 - Выбираем самый похожий на r_i фактор и считаем с каким множителем α нам нужно его брать
 - Добавляем $\lambda\alpha$ к коэффициенту при этом факторе ($\lambda < 1$)
 - Считаем новый остаток r_i
- <http://www-stat.stanford.edu/~tibs/lasso.html>

Нелинейные модели

- Если бы у нас были пропорциональные релевантности независимые факторы, нам бы хватило линейной регрессии
- Это не так и нам понадобятся нелинейные модели
 - Полиномиальные
 - “Нейронные сети”
 - Decision Trees
 - ...

Decision Tree



Boosting

- Построение strong learner как комбинации “weak learners”
- Связь с L1 регуляризацией
 - weak learner = единственный фактор с коэффициентом
 - strong learner = линейная регрессия с L1 регуляризацией
- Для более сложного weak learner boosting дает сложно формализуемую sort of L1 регуляризацию

Bagging

- На каждой итерации будем брать не все самплы, а их случайное подмножество
- Магическим образом более устойчиво
- Defeats boosting impossibility argument
(http://velblod.videolectures.net/2008/pascal2/icml08_helsinki/long_rcn/icml08_long_rcn_01.ppt)

Limit on decision tree leafs

- Дисперсия ошибки значения в листе пропорциональна $1/N$, где N – количество сэмплов в листе
- Введем ограничение – в кошерном дереве должно быть не меньше 10 сэмплов обучающей выборки на лист
- Наш лимит ограничивает ошибку аппроксимации “выравнивая” ее по выборке

TreeNet

- TreeNet товарища Friedman-а это Boosted Decision Tree с Bagging и ограничением на минимальное количество сэмплов в листе
- <http://www.salford-systems.com/doc/GreedyFuncApproxSS.pdf>
- <http://www.salford-systems.com/doc/StochasticBoostingSS.pdf>

MatrixNet



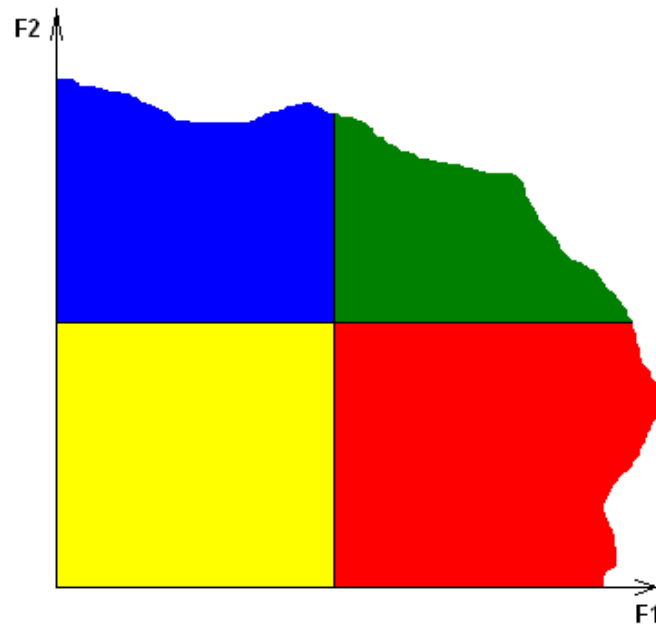
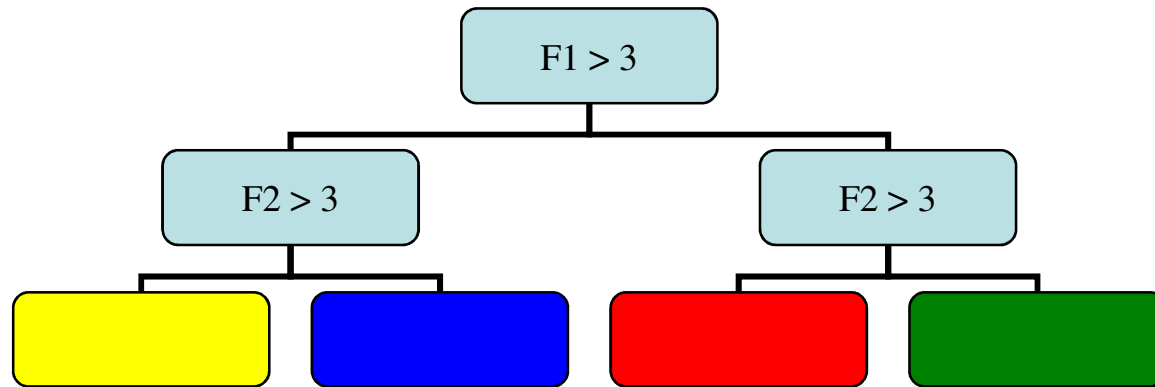
Я

<http://seodemotivators.ru/>

MatrixNet

- MatrixNet отличается в 3-х моментах
 - Использование Oblivious Trees
 - Регуляризация значений в листах вместо ограничения на количество сэмплов в листе
 - Зависимость сложности модели от итерации (начинаем с простых моделей, заканчиваем сложными)

Oblivious Trees



Регуляризация в листьях

- Вместо ограничения на количество сэмплов в листьях будем “регуляризовать” значение в листе
- Например, если домножить значение в листе на $\sqrt{N/(N+100)}$, где N – число сэмплов в листе, то результаты улучшатся.
- Оптимальный способ регуляризации, видимо, зависит от выборки

Другие целевые функции

- А что, если вместо квадратичной ошибки мы хотим оптимизировать что-нибудь другое? Например, для задач классификации больше подходит средний $\log(p)$, где p – вероятность, назначенная моделью правильному ответу
- Получаем обычную задачу максимизации функции, которую можно решать
 - Градиентным спуском = gradient boosting = greedy function approximation
 - Методом Ньютона = logit boost для классификации

Gradient boosting

- На каждом шаге boosting-а вместо невязки r_i мы аппроксимируем производную целевой функции в текущей точке
- Размер шага зависит от величины производной, т.е. от гладкости функции
- Вместо шага по производной в текущей точке мы можем посчитать куда приведет нас производная и шагать в направлении финальной точки траектории

Ranking

- А что же делать, если мы хотим научиться ранжировать?
- Целевая функция для ranking (NDCG/pFound/whatever) задана на порядках и разрывна (описание pFound http://romip.ru/romip2009/15_yandex.pdf)
- Нужна какая-то непрерывная замена. Замены делятся на классы
 - Pointwise (rmse, классификация, ...)
 - Pairwise (RankNet, ...)
 - Listwise (SoftRank, ...)

Luce-Plackett model

- Luce-Plackett model позволяет нам назначить вероятности всем перестановкам, если у нас есть веса документов $\{w_i\}$
- Вероятность перестановки вычисляется рекурсивно. Вероятность поставить документ k на первое место равна $w_k / (w_1 + w_2 + \dots + w_n)$, далее аналогично считаем вероятность выбрать второй документ из оставшихся и т.д. Произведение этих вероятностей равно вероятности перестановки.

Expected rFound

- Для каждой перестановки мы можем посчитать ее $r\text{Found}(\text{perm})$. Также мы знаем вероятность этой перестановки $P_{LP}(\text{perm})$
- Просуммировав $r\text{Found}(\text{perm}) * P_{LP}(\text{perm})$ по всем перестановкам получим expected rFound
- Expected rFound непрерывен и мы можем максимизировать его с помощью gradient boosting
- Вместо rFound мы можем подставить любую нужную нам меру

Вопросы?



*A*kasaka Mitsuki

Everyone possesses many different faces.

For living...

For working...

And for falling in love...

I wonder how many faces I have?

And which one is the real me?

ANIMEWALLPAPERS.COM