

# Il compromesso distorsione-varianza

Data Mining

CLAMSES - University of Milano-Bicocca

Aldo Solari

## Riferimenti bibliografici

- AS §3.3, §4.1
- HTF §2.3, §2.9, §7.2, §7.3
- AS Exercises 3.1, 3.2, 3.3

# Table of Contents

Il segnale e il rumore

Scomposizione distorsione-varianza

Metodi nonparametrici

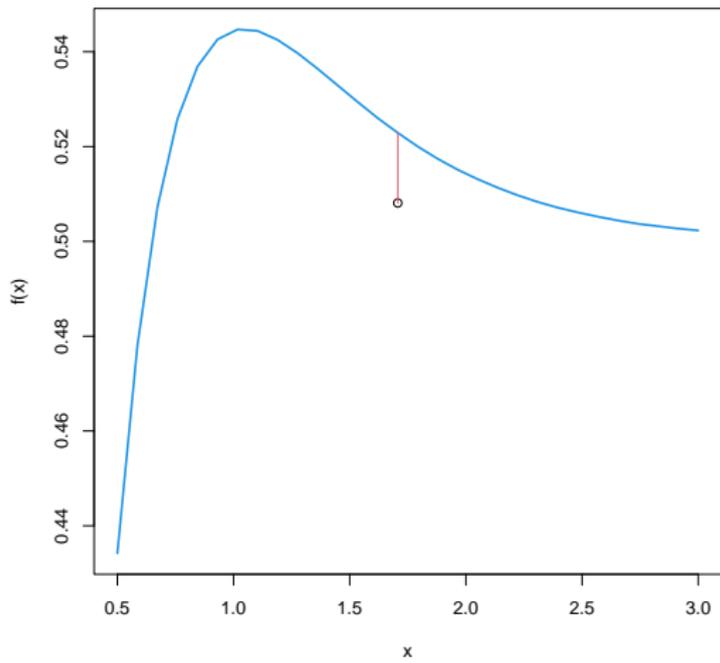
# Il segnale e il rumore

Le risposte  $y_1, \dots, y_n$  sono realizzazioni delle v.c.

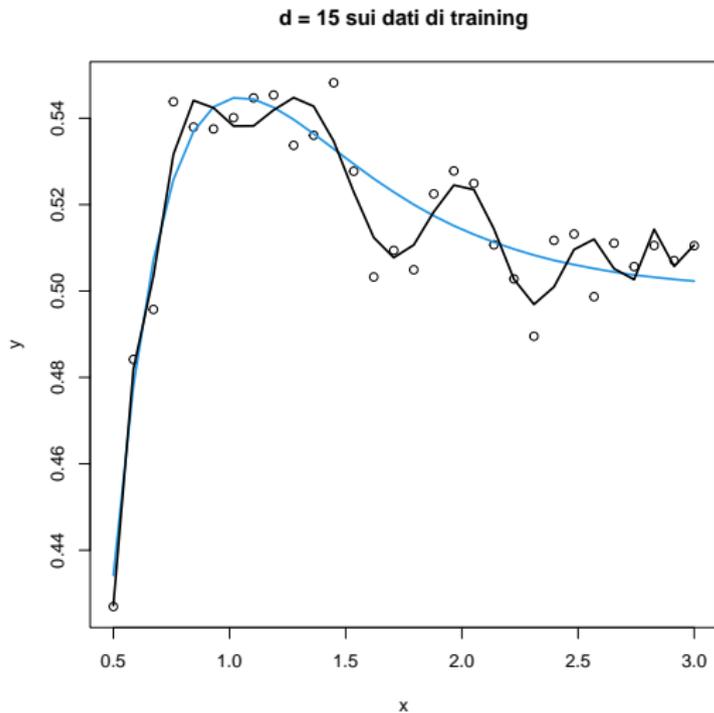
$$Y_i = f(x_i) + \varepsilon_i, \quad i = 1, \dots, n$$

dove

- $f$  è la funzione di regressione (il segnale)
- $\varepsilon$  è il termine di errore (il rumore) dove  $\varepsilon_1, \dots, \varepsilon_n$  sono i.i.d. con  $\mathbb{E}(\varepsilon_i) = 0$  e  $\text{Var}(\varepsilon_i) = \sigma^2$ .



# Sovra-adattamento (overfitting)



Confondere il rumore per il segnale

# Table of Contents

Il segnale e il rumore

Scomposizione distorsione-varianza

Metodi nonparametrici

# Errore di previsione

Funzione di perdita: errore quadratico medio (MSE)

Obiettivo: minimizzare l'errore di previsione atteso (nel setting Fixed-X)

$$\text{ErrF} = \mathbb{E}(\text{MSE}_{\text{Te}}) = \mathbb{E} \left[ \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (Y_i^* - \hat{f}(x_i))^2 \right] = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbb{E} \left[ (Y_i^* - \hat{f}(x_i))^2 \right]$$

dove il valore atteso è rispetto alle v.c.  $Y_1, \dots, Y_n$  e  $Y_1^*, \dots, Y_n^*$

## Fonti di errore

- *Errore irriducibile*

Possiamo fare previsioni senza commettere errori ?

No, neppure se conoscessimo la vera  $f$ , per la presenza del termine di errore  $\varepsilon$

- *Distorsione*

Quanto è lontano (in media) lo stimatore  $\hat{f}$  dalla vera  $f$ ?

Ad esempio, se stimiamo una retta di regressione quando la vera relazione è quadratica

- *Varianza*

Quanto è variabile lo stimatore  $\hat{f}$ ?

In altre parole, quanto variano le nostre stime se le calcoliamo su training set diversi?

# Errore riducibile ed irriducibile

Supponiamo di prevedere  $y_i^*$  con  $\hat{y}_i^* = \hat{f}(x_i)$  dove  $\hat{f}$  è la stima di  $f$  ottenuta con il training set

L'accuratezza di  $\hat{y}_i^*$  dipende da due quantità, l'errore riducibile ed l'errore irriducibile

Abbiamo

$$\begin{aligned}\mathbb{E}[(Y_i^* - \hat{Y}_i^*)^2] &= \mathbb{E}[(f(x_i) + \varepsilon_i^* - \hat{f}(x_i))^2] \\ &= \mathbb{E}[\{f(x_i) - \hat{f}(x_i)\}^2 + \{\varepsilon_i^*\}^2 + 2\{[f(x_i) - \hat{f}(x_i)]\varepsilon_i^*\}] \\ &= \underbrace{\mathbb{E}[\{f(x_i) - \hat{f}(x_i)\}^2]}_{\text{RIDUCIBILE}} + \underbrace{\text{Var}(\varepsilon_i^*)}_{\text{IRRIDUCIBILE}}\end{aligned}$$

dove  $\text{Var}(\varepsilon_i^*) = \sigma^2$

# Errore riducibile

L'errore riducibile può essere ulteriormente scomposto in distorsione (al quadrato) e varianza dello stimatore  $\hat{f}$

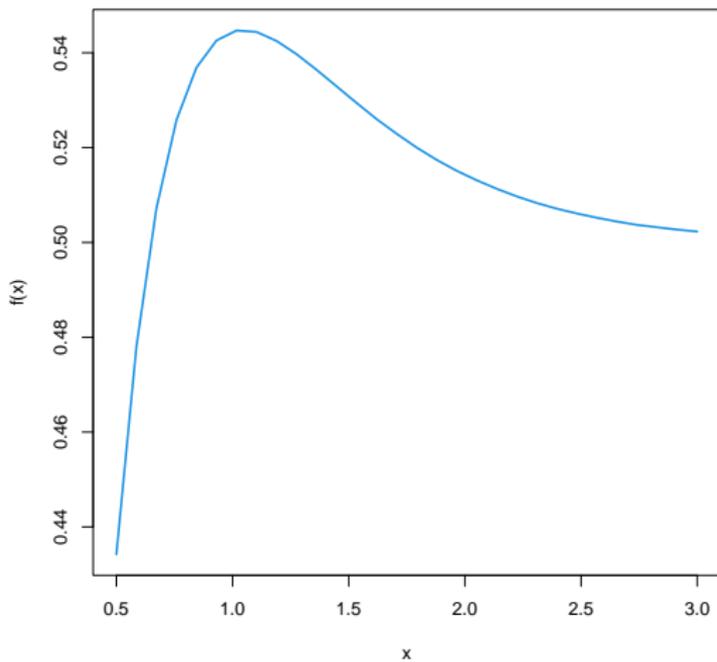
$$\begin{aligned}\mathbb{E}[\{f(x_i) - \hat{f}(x_i)\}^2] &= \mathbb{E}[(f(x_i) - \mathbb{E}\hat{f}(x_i) + \mathbb{E}\hat{f}(x_i) - \hat{f}(x_i))\}^2] \\ &= \underbrace{[\mathbb{E}\hat{f}(x_i) - f(x_i)]^2}_{[\text{Distorsione}(\hat{f}(x_i))]^2} + \underbrace{\text{Var}[\hat{f}(x_i)]}_{\text{Varianza}(\hat{f}(x_i))}\end{aligned}$$

Riassumendo, la scomposizione dell'errore di previsione è data da

$$\text{ErrF} = \sigma^2 + \underbrace{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\mathbb{E}\hat{f}(x_i) - f(x_i))^2}_{\text{Distorsione}^2} + \underbrace{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \text{Var}(\hat{f}(x_i))}_{\text{Varianza}}$$

Distorsione e varianza sono quantità in conflitto e non possiamo minimizzare entrambe contemporaneamente. Dobbiamo quindi scegliere un compromesso (trade-off) tra distorsione e varianza.

Se conoscessimo la vera  $f$ ...



```
sigmatrue = 0.01
x = seq(.5,3,length=30)
n = length(x)
ftrue = c(0.4342,0.4780,0.5072,0.5258,0.5369,
0.5426,0.5447,0.5444,0.5425,0.5397,
0.5364,0.5329,0.5294,0.5260,0.5229,
0.5200,0.5174,0.5151,0.5131,0.5113,
0.5097,0.5083,0.5071,0.5061,0.5052,
0.5044,0.5037,0.5032,0.5027,0.5023)
```

# Distorsione

Per la regressione polinomiale di grado  $d$ , la stima del vettore  $\beta$  (con  $p = d + 1$ ) risulta pari a  $\hat{\beta} = (\mathbf{X}^T \mathbf{X})^{-1} \mathbf{X}^T \mathbf{y}$  dove  $\mathbf{X}$  è la matrice del disegno. La previsione per  $i$ -sima osservazione è  $\hat{f}(x_i) = x_i^T \hat{\beta}$ , dove  $x_i^T$  è l'  $i$ -sima riga di  $\mathbf{X}$ .

La distorsione risulta

$$\begin{aligned}\mathbb{E}[\hat{f}(x_i)] - f(x_i) &= \mathbb{E}[x_i^T (\mathbf{X}^T \mathbf{X})^{-1} \mathbf{X}^T \mathbf{y}] - f(x_i) \\ &= x_i^T (\mathbf{X}^T \mathbf{X})^{-1} \mathbf{X}^T \mathbb{E}[\mathbf{y}] - f(x_i) \\ &= x_i^T (\mathbf{X}^T \mathbf{X})^{-1} \mathbf{X}^T \mathbf{f} - f(x_i)\end{aligned}$$

dove  $\mathbf{f} = (f(x_1), \dots, f(x_n))^T$ .

# Varianza

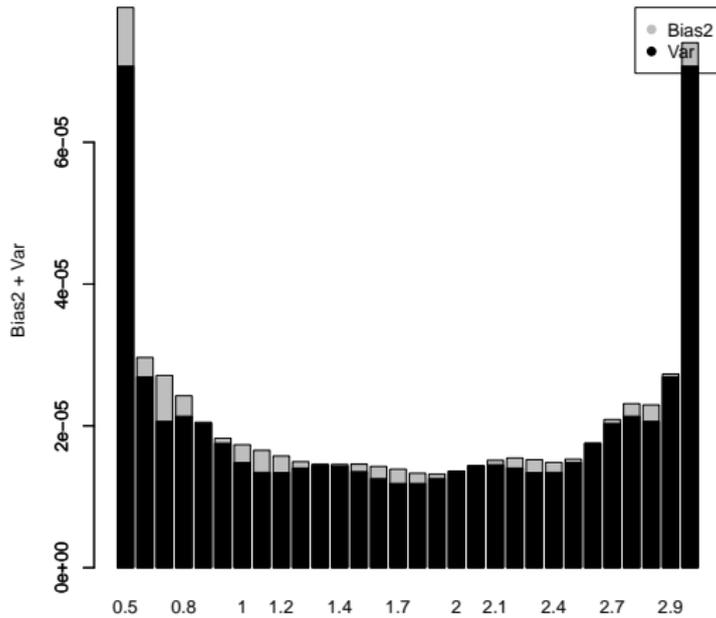
Abbiamo inoltre  $\text{Var}(\hat{\beta}) = \sigma^2(\mathbf{X}^T\mathbf{X})^{-1}$ , quindi la varianza della previsione  $\hat{f}(x_i)$  risulta

$$\text{Var}(\hat{f}(x_i)) = x_i^T \text{Var}(\hat{\beta}) x_i$$

e sommando rispetto alle  $n$  osservazioni

$$\sum_{i=1}^n \text{Var}(\hat{f}(x_i)) = \text{tr}(\mathbf{X}\text{Var}(\hat{\beta})\mathbf{X}^T) = \sigma^2 \text{tr}(\mathbf{X}^T\mathbf{X}(\mathbf{X}^T\mathbf{X})^{-1}) = \sigma^2 p$$

**d = 5**



```
# errore di previsione atteso
sigmatrue^2 + mean( Bias2 ) + mean( Var )
0.0001217199
```

```
# verifichiamo via simulazione l'errore di previsione atteso
```

```
ErrF = function(d){
  y = ftrue + rnorm(n,0,sigmatrue)
  fit = lm(y ~ poly(x,degree=d))
  yhat = fitted(fit)
  y_new = ftrue + rnorm(n,0,sigmatrue)
  MSE.te = mean( (yhat - y_new)^2 )
}
```

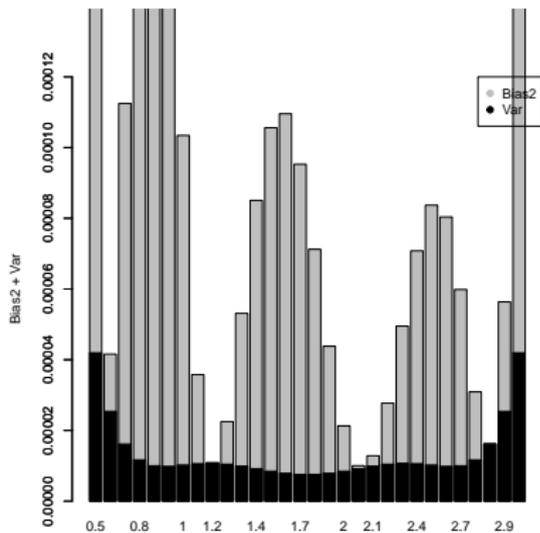
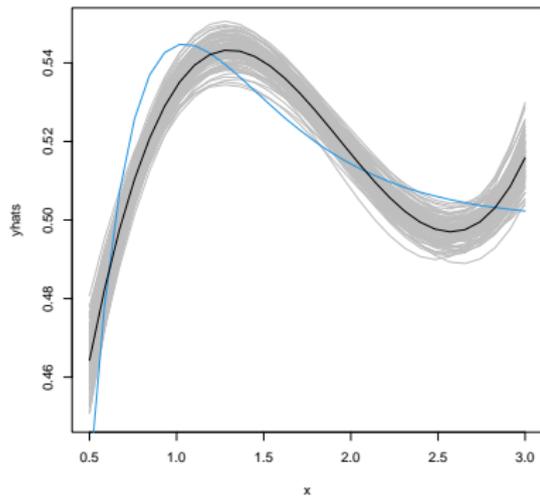
```
B = 1000
```

```
set.seed(123)
```

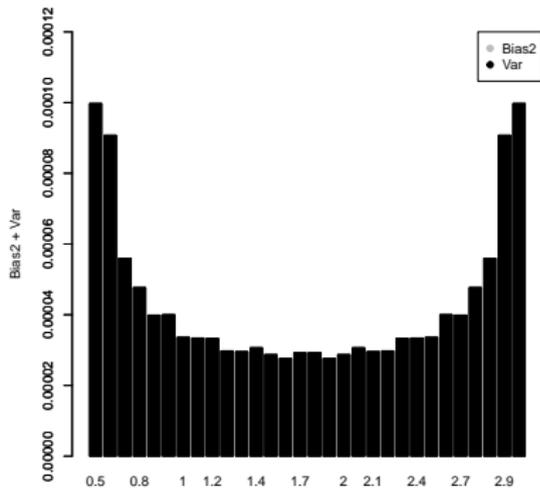
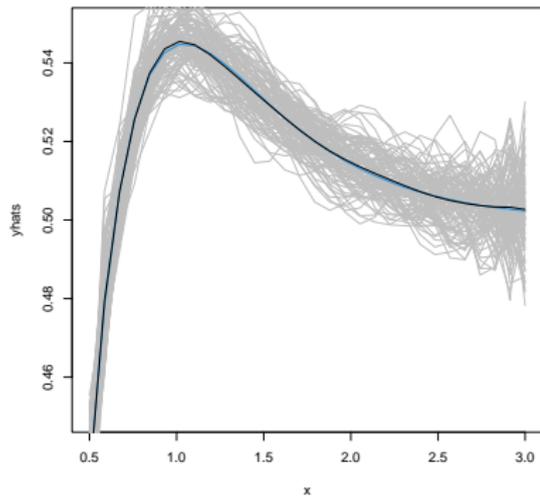
```
mean(replicate(B, ErrF(d=5)))
```

```
0.0001221817
```

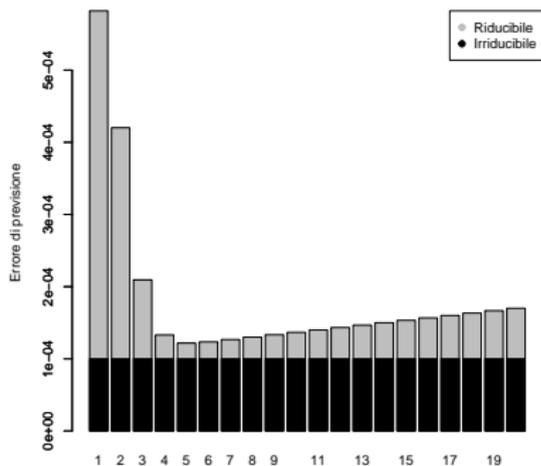
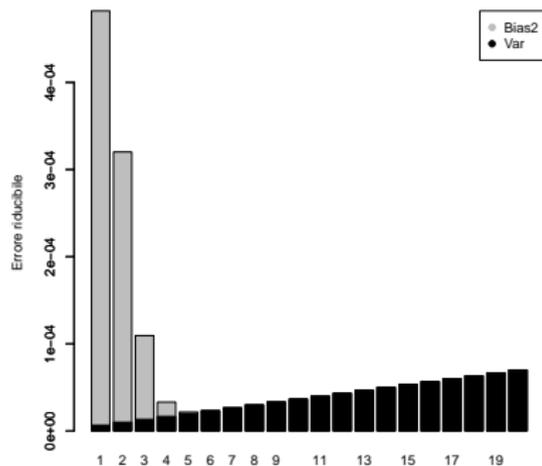
# Regressione polinomiale di grado 3



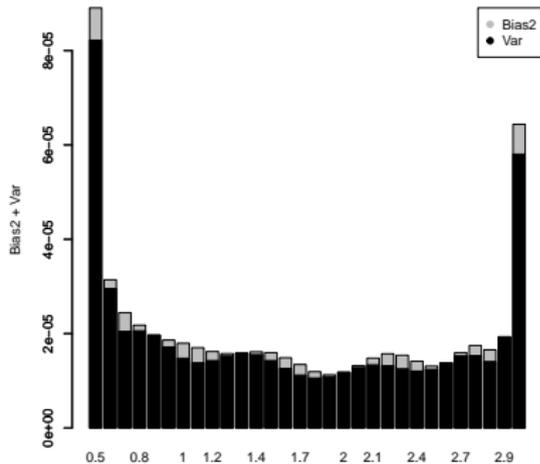
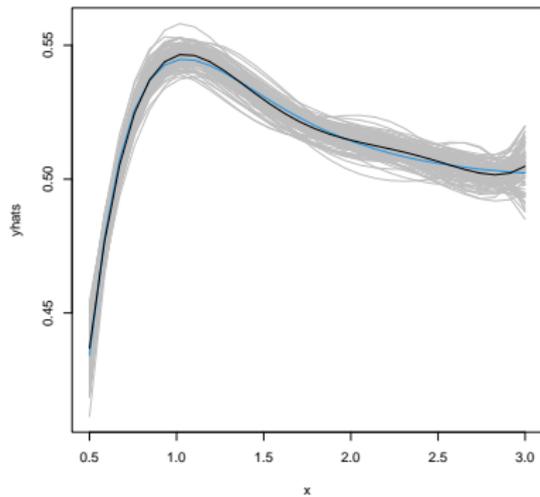
# Regressione polinomiale di grado 12



# Errore riducibile e atteso per $d = 1, \dots, 20$



# Il miglior modello



## Il compromesso distorsione-varianza

- Errore riducibile = Distorsione  $^2$  + Varianza
- Modelli con poca distorsione tendono ad avere elevata variabilità
- Modelli con poca variabilità tendono ad avere elevata distorsione
- Da un lato, anche se il nostro modello è non distorto ( $\mathbb{E}\hat{f}(x_i) = f(x_i)$ ), l'errore di previsione può essere elevato se il modello è molto variabile
- Dall'altro lato, un modello che prevede una costante (e.g.  $\hat{f}(x_i) = 0$ ) ha varianza nulla ma elevata distorsione
- Per prevedere bene, dobbiamo bilanciare la distorsione e la varianza

# Table of Contents

Il segnale e il rumore

Scomposizione distorsione-varianza

Metodi nonparametrici

# Metodi nonparametrici

I metodi nonparametrici non fanno assunzioni specifiche a proposito della forma funzionale della  $f$  (ad esempio, "  $f$  è un polinomio "). Si lascia che i dati "parlino da soli"

Vantaggio: evitando assunzioni sulla forma di  $f$ , permettiamo qualsiasi forma funzionale per  $f$  (anche le più strane e irregolari)

Svantaggio: poichè il problema della stima di  $f$  non si riduce più al problema di stimare  $p$  parametri (se  $p \ll n$ ), risulta necessario avere tante osservazioni (  $n$  elevato )

## Il metodo dei $k$ vicini più vicini

Si consideri il metodo dei  $k$  vicini più vicini (k-nearest neighbors, abbreviato k-NN) per un problema di regressione

Supponiamo di voler prevedere la risposta  $y_1^*$  in corrispondenza ad un certo punto  $x_1^*$ . Definiamo il "vicinato" (neighbourhood) di questo punto con  $N_k(x_1^*)$ : è l'insieme dei  $k$  punti del training set più "vicini" a  $x_1^*$ . Dobbiamo quindi definire una distanza: si può ad esempio considerare la distanza Euclidea tra  $x_i$  e  $x_1^*$

$$\|x_i - x_1^*\|_2 = \sqrt{(x_i - x_1^*)^\top (x_i - x_1^*)} = \sqrt{\sum_{j=1}^p (x_{ij} - x_{1j}^*)^2}$$

dove  $\|\cdot\|_2$  indica la norma Euclidea

La previsione è definita dalla media delle  $k$  risposte  $y_i$  del training set che appartengono al vicinato di  $x_1^*$ , i.e. le  $x_i \in N_k(x_1^*)$

$$\hat{f}(x_1^*) = \frac{1}{k} \sum_{i \in N_k(x_1^*)} y_i$$

# Parametro di regolazione

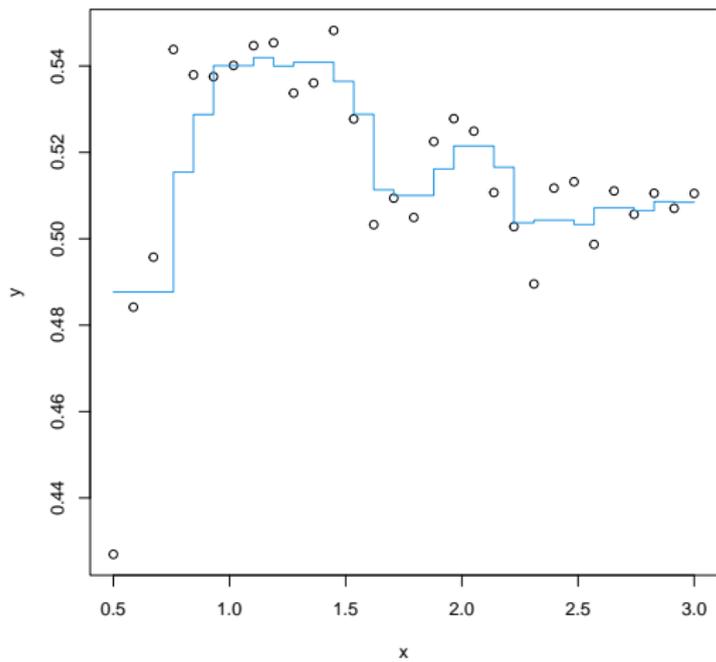
$k$  può assumere valori da 1 a  $n$ , e rappresenta il parametro di regolazione (tuning parameter)

Un  $k$  piccolo corrisponde ad una stima più flessibile, viceversa un  $k$  grande ad una stima meno flessibile

Il caso estremo  $k = n$  corrisponde alla media delle risposte del training:  $\hat{f}(x_1^*) = \bar{y} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i$ , mentre  $k = 1$  corrisponde a  $\hat{f}(x_1^*) = y_i$  per un certo indice  $i$  tale che  $x_i$  è il punto più vicino a  $x_1^*$

Operativamente, poichè il metodo utilizza una distanza, spesso i valori dei predittori vengono standardizzati

**k = 4**



## Errore di previsione atteso per kNN

Nel Fixed-X setting, la distorsione di kNN risulta

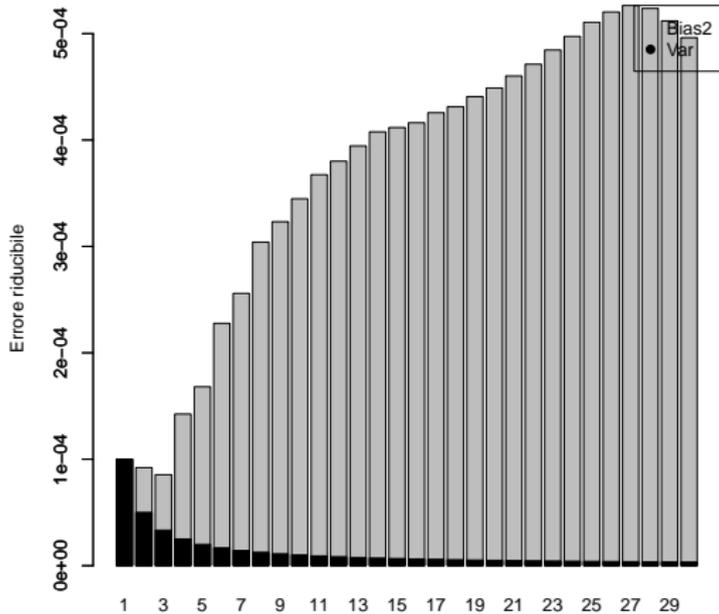
$$\mathbb{E}[\hat{f}(x_i)] - f(x_i) = \frac{1}{k} \sum_{i \in N_k(x_i)} \mathbb{E}[y_i] - f(x_i) = \frac{1}{k} \sum_{i \in N_k(x_i)} f(x_i) - f(x_i)$$

e la varianza di kNN risulta

$$\text{Var}(\hat{f}(x_i)) = \mathbb{E}\{(\hat{f}(x_i) - \mathbb{E}[\hat{f}(x_i)])^2\} = \frac{\sigma^2}{k}$$

quindi l'errore di previsione di kNN si può calcolare come

$$\text{ErrF} = \sigma^2 + \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \left( \frac{1}{k} \sum_{i \in N_k(x_i)} f(x_i) - f(x_i) \right)^2 + \frac{\sigma^2}{k}$$



```
# errore di previsione atteso
sigmatrue^2 + Bias2s[4] +Vars[4]
0.0002424745
```

```
# verifichiamo via simulazione l'errore di previsione atteso
ErrF = function(k){
  y = ftrue + rnorm(n,0,sigmatrue)
  yhat = knn(y ~ x, train, test, distance = 2,
  kernel = "rectangular", k = k)$fitted.values
  y_new = ftrue + rnorm(n,0,sigmatrue)
  MSE.te = mean( (yhat - y_new)^2 )
}
B = 1000
mean(replicate(B, ErrF(k=4)))
0.0002462827
```